

# 中国外汇交易中心 I M I X 协议开发指引

CFETS/K1XXX—2019

---

## 中国外汇交易中心指数产品发行人接口 XML 文档

(V1.4 版)



目 次

前言 ..... IV

引言 ..... V

修 改 历 史 ..... VI

1 范围 ..... 1

2 规范性引用文件 ..... 1

3 文件维护与管理 ..... 1

4 文件使用说明 ..... 1

    4.1 IMIX 报文结构 ..... 1

    4.2 接入方式 ..... 2

    4.3 FTP 地址规划 ..... 2

    4.4 文件目录规划 ..... 2

    4.5 数值类字段长度说明 ..... 5

5 业务场景开发 ..... 5

    5.1 接口流程 ..... 5

    5.2 中国外汇交易中心向发行人传输信息 ..... 7

        5.2.1 投资人信息 ..... 7

            5.2.1.1 投资人信息业务要素 ..... 7

            5.2.1.2 投资人信息 IMIX 报文标准 ..... 8

            5.2.1.3 投资人信息 XML 消息示例 ..... 11

        5.2.2 认购申购赎回申请 ..... 12

            5.2.2.1 认购申购赎回申请业务要素 ..... 12

            5.2.2.2 认购申购赎回申请 IMIX 报文标准 ..... 18

            5.2.2.3 认购申购赎回申请 XML 消息示例 ..... 30

        5.2.3 新开户资料 ..... 32

            5.2.3.1 新开户资料清单文件业务要素 ..... 33

            5.2.3.2 新开户资料清单文件 IMIX 报文标准 ..... 33

            5.2.3.3 新开户资料清单文件 XML 消息示例 ..... 34

        5.2.4 已开户待匹配信息 ..... 35

            5.2.4.1 已开户待匹配信息业务要素 ..... 35

            5.2.4.2 已开户待匹配信息 IMIX 报文标准 ..... 36

            5.2.4.3 已开户待匹配信息 XML 消息示例 ..... 37

        5.2.5 认购处理结果 ..... 38

            5.2.5.1 认购处理结果业务要素 ..... 38

            5.2.5.2 认购处理结果 IMIX 报文标准 ..... 39

            5.2.5.3 认购处理结果 XML 消息示例 ..... 42

5.2.6	认购确认反馈 .....	43
5.2.6.1	认购确认反馈业务要素 .....	43
5.2.6.2	认购确认反馈 IMIX 报文标准 .....	44
5.2.6.3	认购确认反馈 XML 消息示例 .....	47
5.2.7	持有人份额对账 .....	47
5.2.7.1	持有人份额对账业务要素 .....	47
5.2.7.2	持有人份额对账 IMIX 报文标准 .....	48
5.2.7.3	持有人份额对账 XML 消息示例 .....	49
5.3	发行人向中国外汇交易中心传输信息 .....	50
5.3.1	产品持仓信息 .....	50
5.3.1.1	产品持仓信息业务要素 .....	50
5.3.1.2	产品持仓信息 IMIX 报文标准 .....	52
5.3.1.3	产品持仓信息 XML 消息示例 .....	59
5.3.2	产品净值 .....	62
5.3.2.1	产品净值业务要素 .....	62
5.3.2.2	产品净值 IMIX 报文标准 .....	63
5.3.2.3	产品净值 XML 消息示例 .....	65
5.3.3	认购申购赎回确认 .....	66
5.3.3.1	认购申购赎回确认业务要素 .....	66
5.3.3.2	认购申购赎回确认 IMIX 报文标准 .....	70
5.3.3.3	认购申购赎回确认 XML 消息示例 .....	76
5.3.4	持有人名册 .....	78
5.3.4.1	持有人名册业务要素 .....	78
5.3.4.2	持有人名册 IMIX 报文标准 .....	78
5.3.4.3	持有人名册 XML 消息示例 .....	79
5.3.5	现金差额和现金替代的退补明细 .....	80
5.3.5.1	现金差额和现金替代的退补明细业务要素 .....	80
5.3.5.2	现金差额和现金替代的退补明细 IMIX 报文标准 .....	81
5.3.5.3	现金差额和现金替代的退补明细 .....	83
5.3.6	产品分红 .....	84
5.3.6.1	产品分红业务要素 .....	84
5.3.6.2	产品分红 IMIX 报文标准 .....	84
5.3.6.3	产品分红 XML 消息示例 .....	86
5.3.7	PCF 清单 .....	86
5.3.7.1	PCF 清单业务要素 .....	87
5.3.7.2	PCF 清单 IMIX 报文标准 .....	90
5.3.7.3	PCF 清单 XML 消息示例 .....	94
5.3.8	产品状态 .....	96
5.3.8.1	产品状态业务要素 .....	96
5.3.8.2	产品状态 IMIX 报文标准 .....	96
5.3.8.3	产品状态 XML 消息示例 .....	97
5.3.9	赎回债券清单 .....	97
5.3.9.1	赎回债券清单业务要素 .....	97

5.3.9.2 赎回债券清单 IMIX 报文标准 .....	98
5.3.9.3 赎回债券清单 XML 消息示例 .....	99
5.3.10 申购债券清单 .....	100
5.3.10.1 申购债券清单业务要素 .....	100
5.3.10.2 申购债券清单 IMIX 报文标准 .....	101
5.3.10.3 申购债券清单 XML 消息示例 .....	102
5.3.11 开户结果 .....	103
5.3.11.1 开户结果业务要素 .....	103
5.3.11.2 开户结果 IMIX 报文标准 .....	104
5.3.11.3 开户结果 XML 消息示例 .....	109
5.3.12 认购处理结果确认 .....	109
5.3.12.1 认购处理结果确认业务要素 .....	109
5.3.12.2 认购处理结果确认 IMIX 报文标准 .....	111
5.3.12.3 认购处理结果确认 XML 消息示例 .....	114
5.3.13 现金部分结算明细 .....	115
5.3.13.1 现金部分结算明细业务要素 .....	115
5.3.13.2 现金部分结算明细 IMIX 报文标准 .....	116
5.3.13.3 现金部分结算明细 XML 消息示例 .....	118
参考文献 .....	119
图 1 IMIX 报文结构 .....	2
图 2 接口流程图 .....	6
表 1 投资人信息业务要素 .....	7
表 2 投资人信息 IMIX 报文标准 .....	8
表 3 认购申购赎回申请业务要素 .....	13
表 4 认购申购赎回申请 IMIX 报文标准 .....	18
表 5 新开户资料清单文件业务要素 .....	33
表 6 新开户资料清单文件 IMIX 报文标准 .....	33
表 7 已开户待匹配信息业务要素 .....	35
表 8 已开户待匹配信息 IMIX 报文标准 .....	36
表 9 认购处理结果业务要素 .....	38
表 10 认购处理结果 IMIX 报文标准 .....	39
表 11 认购确认反馈业务要素 .....	43
表 12 认购确认反馈 IMIX 报文标准 .....	44
表 13 持有人份额对账业务要素 .....	47
表 14 持有人份额对账 IMIX 报文标准 .....	48
表 15 产品持仓信息业务要素 .....	50
表 16 产品持仓信息 IMIX 报文标准 .....	52
表 17 产品净值业务要素 .....	62
表 18 产品净值 IMIX 报文标准 .....	63
表 19 认购申购赎回确认业务要素 .....	66

表 20	认购申购赎回确认 IMIX 报文标准 .....	70
表 21	持有人名册业务要素 .....	78
表 22	持有人名册 IMIX 报文标准 .....	78
表 23	现金差额和现金替代的退补明细业务要素 .....	80
表 24	现金差额和现金替代的退补明细 IMIX 报文标准 .....	81
表 25	产品分红业务要素 .....	84
表 26	产品分红 IMIX 报文标准 .....	85
表 27	PCF 清单业务要素 .....	87
表 28	PCF 清单 IMIX 报文标准 .....	90
表 29	产品状态业务要素 .....	96
表 30	产品状态 IMIX 报文标准 .....	96
表 31	赎回债券清单业务要素 .....	98
表 32	赎回债券清单 IMIX 报文标准 .....	98
表 33	申购债券清单业务要素 .....	100
表 34	申购债券清单 IMIX 报文标准 .....	101
表 35	开户结果业务要素 .....	103
表 36	开户结果 IMIX 报文标准 .....	104
表 37	认购处理结果确认业务要素 .....	110
表 38	认购处理结果确认 IMIX 报文标准 .....	111
表 39	现金部分结算明细业务要素 .....	115
表 40	现金部分结算明细 IMIX 报文标准 .....	116

## 前 言

本文件依据中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心（以下简称交易中心）指数产品发行人接口XML内容起草。

本文件由中国外汇交易中心归口。

本文件提出单位：中国外汇交易中心。

本文件负责起草单位：中国外汇交易中心。

本文件主要起草人：杨帆、茅廷、周颖、胡珺、李靖民、曹琦、刘丽莉、杨志表、胡冰冰、夏玉姣、梁婷、刘开心。

## 引言

随着我国金融改革不断深化，银行间市场信息化也在不断提高，金融标准逐步渗透到市场活动的各个层面。中国外汇交易中心积极贯彻总行战略部署，持续推进银行间市场标准化建设，牵头编制了JR/T 0065—2011《银行间市场基础数据元》、JR/T 0066—2011《银行间市场业务数据交换协议》、JR/T 0078—2014《银行间市场数据接口》等多项金融行业标准，以此为基础打造了直通式处理接口、市场行情接口、报价接口、交易接口等多项数据接口服务，并面向市场推出了包括规范性指导文件、应用编程接口(API)、技术与业务支持在内的数据接口开发服务体系。IMIX协议开发指引作为体系中的重要环节，是数据接口系统开发的规范性约束文件。因此，本次修订更加注重我国银行间市场自身特点和标准化要求，进一步发挥对系统建设的指导作用，为建设银行间市场统一业务数据交换体系奠定坚实基础。



## 修 改 历 史

人员	审核人	版本号	日期	修改内容
夏玉姣		0.1	2018-05-28	1. 创建文档。
夏玉姣		0.1	2018-06-06	1. 根据反馈的意见，所有 XML 增加记录数，详见每条报文； 2. 调整了报文个别格式及笔误问题； 3. 业务要素表中“IMIX 域”列增加了组件名描述。
夏玉姣		0.1	2018-06-08	1. 全文接口中增加 IMIX 报文标准。
夏玉姣		0.1	2018-06-12	1. 5.4 认购申购赎回申请章节中，增加代理行行号字段； 2. 5.6 持有人份额对账中，份额原始来源字段补充枚举值：2-定期定额申购，3-分红。
杨志表		0.2	2018-06-15	1. 5.5 章节认购申购赎回确认中，字段“交易处理返回代码”，增加枚举“8-失败”，并对应增加字段“出错详细信息”（1328 RejectText）； 2. 5.5.1 章节认购申购赎回确认业务要素中，纠正“巨额购买处理标志”与“巨额赎回处理标志”对应错误域的笔误，不影响 XML 消息示例； 3. 补充相关字段的枚举，具体如下： SecurityDefinitionType=15 表示产品持仓信息、 SecurityDefinitionType=16 表示产品净值信息； ComplexEventType=104 表示普通净值、 ComplexEventType=105 表示申购净值、 ComplexEventType=106 表示赎回净值； 4. 补充全文中字段的 IMIX 域号，不影响 XML 消息示例。
夏玉姣		0.3	2018-06-22	1. 新增字段的最大长度、单位、精度，具体请见 5.1-5.6 章节中的业务要素表。
夏玉姣		0.4	2018-06-26	1. 增加字段选填说明，具体见 5.1-5.6 章节中的业务要素表； 2. 5.1 产品持仓信息章节，增加资产类型、资产交易市场字段的枚举说明；增加资产币种枚举说明；修改摊余成本对应 IMIX 域和 XML 名称；修改“公允价值（全价）”为“公允价值（净价）”，并修改对应 IMIX 域和 XML 名称；新增资产总值、占净值比例字段；资产份额单位改为：份； 3. 5.2 产品净值章节，增加结算币种枚举说明；

				<p>4. 5.4 认购申购赎回申请章节,“原流水号”改为“原成交编号”,对应 IMIX 与和 XML 名称不变;删除手续费字段;</p> <p>5. 5.5 认购申购赎回确认章节,新增流水号字段;修改业务代码、份额强制调整标志字段的枚举描述;</p> <p>6. 5.6 持有人份额对账章节,删除份额注册日期、份额原始来源字段。</p>
夏玉姣		0.5	2018-06-28	<p>1. 修改 IMIX 域名所对应的域号,此改动为 IMIX 协议整理,不涉及 XML 文件修改,故对该文档没有影响;</p> <p>以下内容涉及 XML 文件或业务字段修改,请关注,具体如下:</p> <p>2. 5.1 产品持仓信息章节,“应计利息”字段改为“总应计利息”,对应 IMIX 域和 XML 名称不变,最大长度改为 16 位;公允价值(净价)字段精度改为 4 位;</p> <p>3. 5.4 认购申购赎回申请章节,跨境标识字段对应枚举值改为 Y 和 N;</p> <p>4. 5.5 认购申购赎回确认章节中,成交编号、产品单位净值字段增加传输规则;业务过程完全结束标识、是否注册登记人发起业务标志字段对应枚举值改为 Y 和 N;</p> <p>5. 5.6 持有人份额对账章节,“交易确认日期”字段改为“日期”,并修改对应 IMIX 域和 XML 名称。</p>
夏玉姣		0.6	2018-07-18	<p>1. 应业务要求,将 5.5 认购申购赎回确认章节中,交易确认份数、交易确认金额字段中的“交易确认份数和交易确认金额填其中一个”描述去除。</p>
夏玉姣		0.7	2018-08-09	<p>1. 5.1. 产品持仓信息中,“资产交易市场”增加枚举:02 表示上海证券交易所,03 表示深圳证券交易所;“资产份额”、“资产面额”、“摊余成本”、“资产总值”字段修改最大长度为 31 位;“总应计利息”改为“应计利息”,并增加描述:每份资产的应计利息;“公允价值(净价)”增加描述:每份资产的净价。</p>
夏玉姣		0.8	2018-08-13	<p>1. 5.5 认购申购赎回确认章节,成交编号修改其描述:“业务代码为 130、122、124 时,该字段必传,且需与认购申购赎回申请中的成交编号保持一致;业务代码为其他代码时,该字段不传。”;业务代码增加枚举值:151 表示产品到期兑付。</p>
梁婷		0.9	2018-09-03	<p>1. 补充全文中所有“币种”相关字段的枚举值。</p>
夏玉姣		1.0	2018-09-11	<p>1. 评审通过,升为 V1.0 正式版。</p>
梁婷		1.1	2018-09-26	<p>1. 全文业务要素数据类型为小数的,字段最大长度</p>

				增加一位。
夏玉姣		1. 2	2019-04-01	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 增加 4. 2-4. 4 章节关于接入方式, FTP 下载地址的说明;</li> <li>2. 新增 5. 1 章节接口流程;</li> <li>3. 将全文接口调整章节, 归纳到 5. 2 和 5. 3 章节, 并在全文接口中的业务要素表中增加“是否必填”和“说明”两列, 其中说明列中增加业务逻辑说明; 并相应修改全文接口中的 IMIX 报文标准标中的“说明”列, 使其与业务要素表保持一致;</li> <li>4. 业务过程完全结束标识对应域的枚举值为 Y 和 N, 故将 5. 3. 3. 3 认购申购赎回确认 XML 消息示例章节中 CompletedIndicator 的取值示例由“0/1”修改为“Y/N”;</li> <li>5. 指引名称由“中国外汇交易中心 CTP 产品交易接口 XML 文档”变更为“中国外汇交易中心指数产品发行人接口 XML 文档”。</li> </ol>
刘开心		1. 3	2019-06-06	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 新增 5. 2. 4 已开户待匹配信息章节、5. 3. 5 现金差额和现金替代的退补明细、5. 3. 6 产品分红、5. 3. 7 PCF 清单、5. 3. 8 产品状态、5. 3. 9 赎回债券清单、5. 3. 10 申购债券清单、5. 3. 11 开户结果章节、5. 2. 3 新开户资料;</li> <li>2. 5. 2. 2 认购申购赎回申请章节新增字段“投资状态”“申赎模式”, “申请模式”, “申请债券代码”, “申请债券券面总额”, “托管账号户名”, “托管账号”, “申请总预估现金差额”, “申请总替代金额”, “申请现金结算总额”, “托管机构”, “申请替代金额”, 并修改部分字段的传输场景;</li> <li>3. 5. 3. 3 认购申购赎回确认章节新增字段“交易确认债券代码”、“交易确认债券券面总额”, “交易确认债券结算金额”, “机构中文全称”, “申请债券代码”, “申请债券券面总额”, 并修改部分字段的传输场景, 删除字段“转入/转出标识”、“利息税”、“目标产品的单位净值”、“目标产品的确认份数”、“是否注册登记人发起业务标志”、“转换时的目标产品代码”、“巨额赎回处理标志”、“巨额购买处理标志”;</li> <li>4. 5. 3. 2 产品净值章节, 字段“产品总份数”是否必填修改为“否”, 移除条件必填的填写说明。</li> <li>5. 修改 5. 1 章节接口流程图及段落描述内容;</li> <li>6. 新增 4. 5 章节数值类字段长度说明。</li> <li>7. 4. 4 文件目录规划章节新增接口传输目录。</li> </ol>
刘开心		1. 4	2019-08-29	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 新增 5. 2. 5 认购处理结果、5. 2. 6 认购确认反馈、</li> </ol>

				<p>5.3.12 认购处理结果确认、5.3.13 现金部分结算明细、5.2.7 持有人份额对账章节。</p> <p>2. 5.3.2 产品净值章节中，字段名称“产品名称”改为“产品中文全称”；5.3.4 持有人份额对账章节中，字段名称“持有人可用产品份数”改为“可用份数”，字段名称“产品冻结总份数”改为“冻结份数”；将5.3.4 章节名称由“持有人份额对账”变更为“持有人名册”，且报文中的标识域 773 ConfirmType 取值由 109 改为 118。</p> <p>3. 5.3.5 现金差额和现金替代的退补明细中，字段“资金类型”增加两个枚举：现金差额、替代现金。</p>
--	--	--	--	--

# 中国外汇交易中心指数产品发行人接口 XML 文档

## 1 范围

本文件规定了中国外汇交易中心指数产品发行人接口XML的数据内容、数据格式、遵循标准和使用说明。

## 2 规范性引用文件

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

JR/T 0065-2011银行间市场基础数据元

JR/T 0066-2011银行间市场业务数据交换协议

JR/T 0078-2014银行间市场数据接口

## 3 文件维护与管理

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

## 4 文件使用说明

### 4.1 IMIX 报文结构

IMIX报文结构如图1所示。

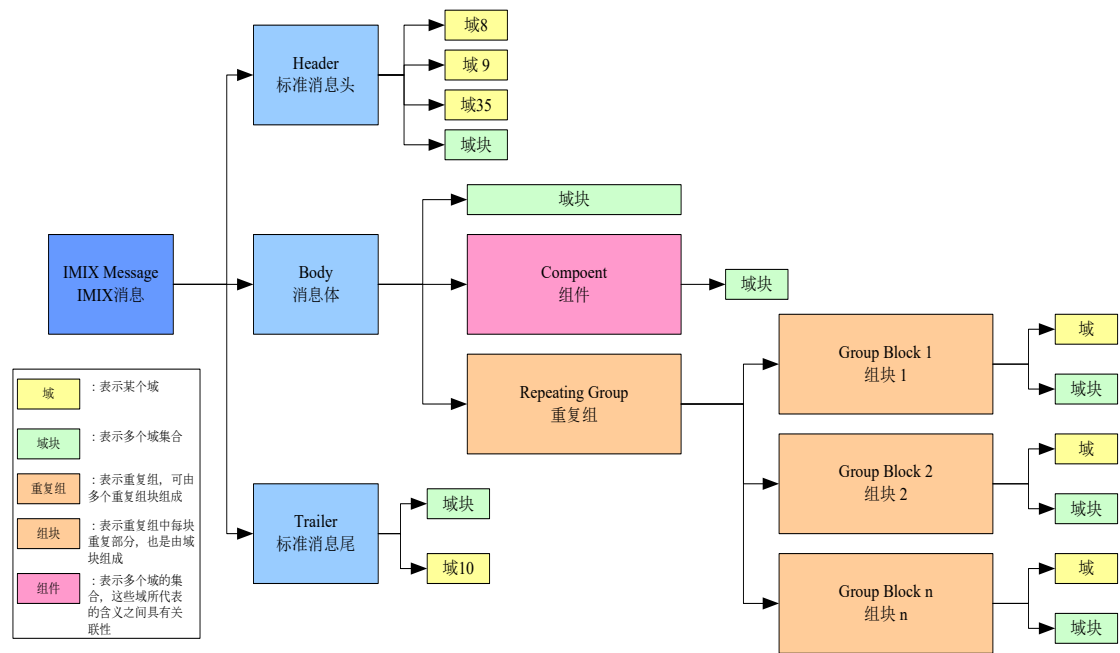


图1 IMIX 报文结构

4.2 接入方式

发行人每日使用中国外汇交易中心提供的账号登陆外汇交易中心的文件服务器，通过FTP方式完成取文件（get）和放文件（put）的操作。

4.3 FTP 地址规划

目前规划FTPS地址如下表（中国外汇交易中心内部地址，待定）。

环境	外网 FTP 服务器	端口
生产	200.31.71.72	1250

4.4 文件目录规划

发行人账户登录后，在根目录下可访问：/CFETSTOXXX/ 目录和/XXXTOCFETS/ 目录。 发行人对/XXXTOCFETS/ 目录有读、写、创建目录等权限，对/CFETSTOXXX/ 有只读权限，其中XXX为发行人英文简称。

a) 中国外汇交易中心向发行人传输信息的文件，发行人可在/CFETSTOXXX/CDIS/ 目录下对应的路径下载，具体说明如下：

1) 投资人信息：

下载目录：/CFETSTOXXX/CDIS/InvestorInfo/yyyy/mm/dd

文件名（日终全量）： investor\_info\_yyyymmdd.xml

文件名（实时增量）： investor\_info\_yyyymmdd\_序号从 1 开始.xml

2) 认购申购赎回申请信息：

下载目录： /CFETSTOXXX/CDIS/ProductApply/yyyy/mm/dd

文件名（日终全量）： subscription\_purchase\_redemption\_apply\_yyyymmdd.xml

文件名（实时增量）：subscription\_purchase\_redemption\_apply\_yyyymmdd\_序列号从 1 开始.xml

### 3) 投资人已开户待匹配信息

下载目录：\$HOME/CFETSTOXXX/CDIS/KHXX/yyyy/mm/dd/

文件名（实时增量）：match\_account\_投资人 21 位机构代码\_yyyymmdd\_序列号从 1 开始.xml

文件名（日终全量）：match\_account\_yyyymmdd.xml

### 4) 投资人新开户资料

下载目录：\$HOME/Investor/机构中文简称-投资人 21 位机构代码/yyyymmdd

文件名（实时增量）：open\_account\_投资人 21 位机构代码\_yyyymmdd\_序列号从 1 开始.zip(.rar)

文件名（日终全量）：open\_account\_yyyymmdd.xml

### 5) 认购处理结果

下载目录：/CFETSTOXXX/CDIS/RGCLJG/yyyy/mm/dd

文件名（日终全量）：RGCLJG\_account\_yyyymmdd.xml

### 6) 认购确认反馈

下载目录：/CFETSTOXXX/CDIS/RGQRFK/yyyy/mm/dd

文件名（日终全量）：RGQRFK\_account\_yyyymmdd.xml

### 7) 持有人份额对账

下载目录：/CFETSTOXXX/CDIS/CYRFEDZ/yyyy/mm/dd

文件名（日终全量）：CYRFEDZ\_account\_yyyymmdd.xml

当下载目录下有相同的文件名.finish文件时表示交易中心该目录下对应的文件上传成功，发行人可下载并处理。

b) 发行人向中国外汇交易中心传输信息的文件，发行人需在/XXXTOCFETS/目录下创建不同目录并将文件上传至对应目录，具体说明如下：

#### 1) 持有人名册：

上传目录 /XXXTOCFETS/TA/ShareReconciliation/yyyy/mm/dd

文件名 share\_reconciliation\_yyyymmdd.xml

#### 2) 产品净值：

上传目录/XXXTOCFETS/TA/NetValue/yyyy/mm/dd

文件名 net\_value\_yyyymmdd.xml

#### 3) 认购申购赎回确认：

上传目录/XXXTOCFETS/TA/ProductConfirm/yyyy/mm/dd

文件名 subscription\_purchase\_redeem\_confirm\_yyyymmdd.xml

4) 产品持仓:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/PositionInfo/yyyy/mm/dd

文件名 position\_info\_yyyymmdd.xml

5) 现金差额和现金替代的退补明细:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/TBMX/yyyy/mm/dd

文件名 TBMX\_info\_yyyymmdd.xml

6) 产品分红:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/CPFH/yyyy/mm/dd

文件名 CPFH\_info\_yyyymmdd.xml

7) PCF清单:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/PCFQD/yyyy/mm/dd

文件名 PCFQD\_info\_yyyymmdd.xml

8) 申购债券清单:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/SGZQQD/yyyy/mm/dd

文件名 SGZQQD\_info\_yyyymmdd.xml

9) 赎回债券清单:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/SHZQQD/yyyy/mm/dd

文件名 SHZQQD\_info\_yyyymmdd.xml

10) 产品状态:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/CPZT/yyyy/mm/dd

文件名 CPZT\_info\_yyyymmdd.xml

11) 开户结果:

上传目录/XXXTOCFETS/CM/KHJG/yyyy/mm/dd

文件名 KHJG\_info\_yyyymmdd.xml

12) 认购处理结果确认:

上传目录 /XXXTOCFETS/CM/RGCLJGQR/yyyy/mm/dd

文件名 RGCLJGQR\_info\_yyyymmdd.xml

13) 现金部分结算明细:

上传目录 /XXXTOCFETS/CM/XJBFJSMX/yyyy/mm/dd

文件名 XJBFJSMX\_info\_yyyymmdd.xml



在dd 目录下上传对应文件，并且上传结束后，添加一下 yyyyymmdd.finish表示完成，交易中心可下载并处理。

注：yyyy mm dd 表示年月日，为自然日。

#### 4.5 数值类字段长度说明

在本指引中，数据类型为数值且含有精度的字段，小数点算作一位长度，例：2.42的长度为4。

### 5 业务场景开发

#### 5.1 接口流程

中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统7\*24小时向发行人开放FTP文件接口，若未完成传输或遇到传输问题需人工介入。

系统服务时间段内（目前为8：00-19：00，该参数由中国外汇交易中心适时调整），中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统实时增量将新增投资人信息（5.2.1）（非用于基金开户、仅传输基础信息）、新开户资料（5.2.3）、已开户待匹配信息（5.2.4）发给发行人，新开户资料在FTP存储时间为7天，若规定期限外需要开户信息，请自行在客户端开户信息页面查看下载。另每日19:30中国外汇交易中心会发送全量文件给发行人；如果当日没有投资信息，传输空文件。每日9:00-15:00为认申赎申请时间，中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统实时增量将认购申购赎回申请信息（5.2.2）发送给发行人，另每日15:30中国外汇交易中心会发送全量文件给发行人，并在次日开盘前发送持有人份额对账信息（5.2.7）给发行人。

认购结束日日终，中国外汇交易中心发送认购处理结果（5.2.5）给发行人，发行人于认购结束后发送认购处理结果确认（5.3.12）、认购确认（5.3.3）给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心随后发送认购确认反馈（5.2.6）给发行人。

对于申赎方式为实物申赎的产品，发行人需于每日开盘前，发送PCF清单（5.3.7）给中国外汇交易中心。对于所有产品，发行人均可选择在每日开盘前，发送申购债券清单（5.3.10）和赎回债券清单（5.3.9）给中国外汇交易中心。

对于申请方式为PCF的申购和赎回申请，发行人需于次日开盘前，发送申购赎回确认信息（5.3.3）给中国外汇交易中心。此外，发行人需发送现金差额和现金替代的退补明细（5.3.5）、现金部分结算明细（5.3.13）给中国外汇交易中心。

对于申请方式为NAV的申购和赎回申请，发行人完成份额确认后，发送申购赎回确认信息（5.3.3）给中国外汇交易中心。

发行人每日批量将持有人名册（5.3.4）、当日产品持仓信息（5.3.1）（若有更新）、产品净值信息（5.3.2）、产品分红（5.3.6）（若有）、产品状态（5.3.8）、开户结果（5.3.11）（若有）信息发送至中国外汇交易中心。

接口简要流程图请见图2。

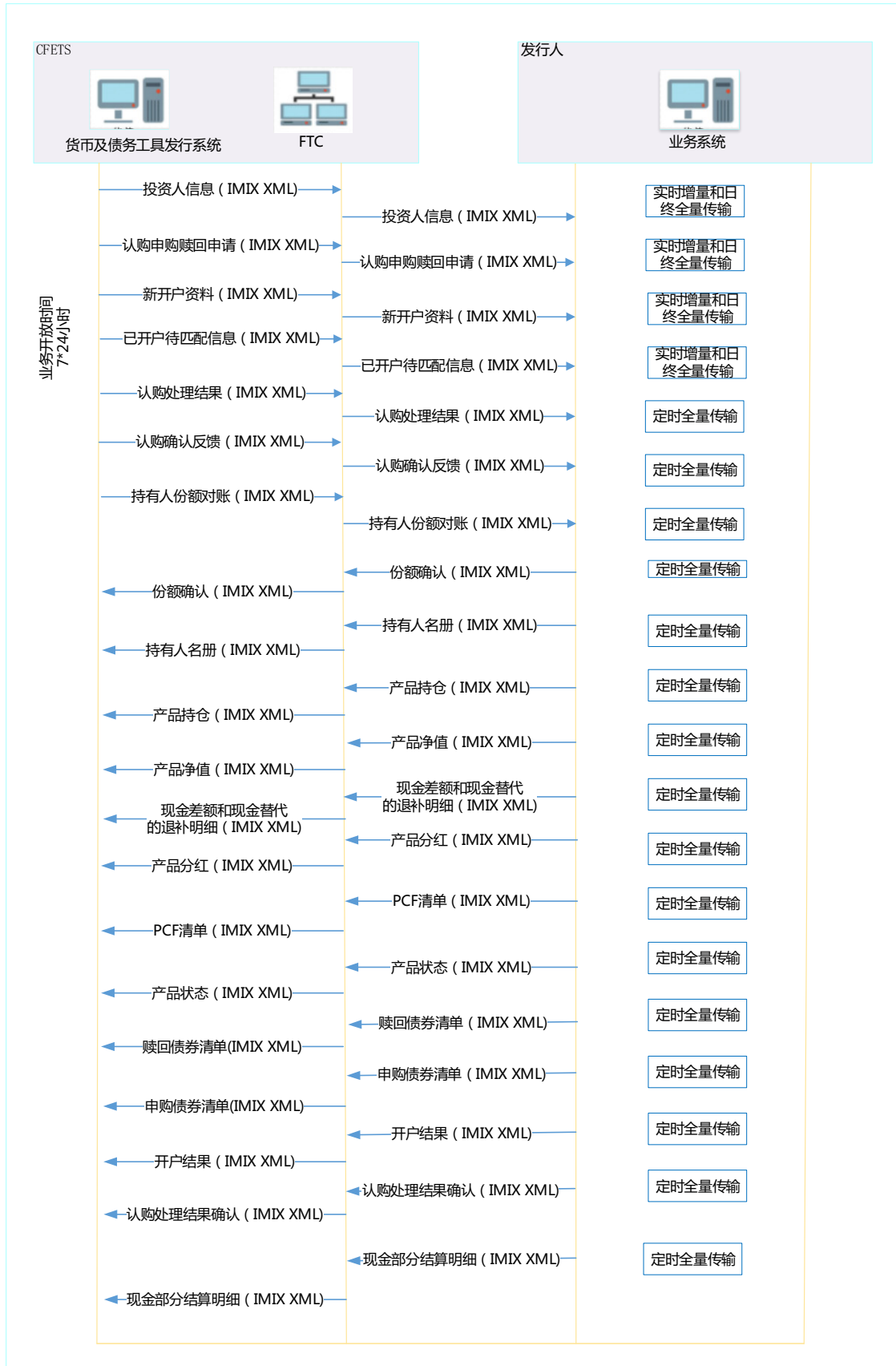


图2 接口流程图

## 5.2 中国外汇交易中心向发行人传输信息

### 5.2.1 投资人信息

中国外汇交易中心每日实时增量将当日有过投资的新增投资人信息以xml文件的方式传输给发行人。若投资人信息发生变更，中国外汇交易中心则将更新后的投资人信息传输给发行人。另中国外汇交易中心每日日终会发送全量“投资人信息”文件给发行人；如果当日没有投资信息，传输空文件。

投资人信息文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.2.1.1 投资人信息业务要素

中国外汇交易中心发送投资人信息，具体业务要素请见表1。

表1 投资人信息业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
流水号	1505PartyDetailsListRequestID	ReqID	是	格式为日期+四位数字， 如 201806260001 文本，最大长度 12 位
日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS
时间			是	
业务代码	使用 PartyDetailListUpdateGroup 组件 1324 ListUpdateAction	使用 PtyDetlUpd 组件 ListUpdActn	是	枚举值： A-新增 M-修改 D-删除 若为新增的投资人，填写 A 表示新增； 若投资人信息有更新时，填写 M 表示修改。
机构名称	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 124 时表示机构中文全称 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=124 时，ID 的值	是	投资人的中文全称 文本，最大长度 300 位
机构 21 位码	使用 PartyDetailGrp 组件 1693 PartyDetailRole 取值 1 时 1691PartyDetailID 的值	使用 PtyDetl 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本，投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
法人代表	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 4004 时表示法人代码 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=4004 时，ID 的 值	是	文本，最大长度 300 位

地址	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 6 时表示地址 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=6 时, ID 的值	否	文本, 最大长度 300 位
交易员姓名	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 101 时表示交易员姓名 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=101 时, ID 的值	是	该投资人的第一笔认购/申 购/赎回操作时的交易员 填写当天投资人的第一笔认 购/申购/赎回操作时的交易 员姓名, 场务人员填写“-” 文本, 最大长度 300 位
传真	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 4000 时表示传真 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=4000 时, ID 的 值	否	该交易员的传真 填写该交易员的传真, 场务 人员填写“-” 最大长度 50 位
电话号码	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 7 时表示电话号码 1695PartyDetailSubID 填写 具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=7 时, ID 的值	否	该交易员的电话号码 该交易员的电话号码, 场务 人员填写“-” 文本, 最大长度 50 位
摘要/说明	58 Text	Txt	否	传输投资人的机构类型 文本, 最大长度 60 位

## 5.2.1.2 投资人信息 IMIX 报文标准

投资人信息IMIX报文标准见表2。

表2 投资人信息 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	CX	报文类型 CX- PartyDetailsDef initionRequest
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
57				TargetSubID	XXXX	报文接收方子标

						志
34				MsgSeqNum	1	报文序列号
52				SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>						
1505				PartyDetailsListRequestID	XXX	流水号, 格式为日期+四位数字, 如 201806260001 文本, 最大长度 12 位
60				TransactTime	20180529-15:08:25	日期、时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS
58				Text	XXX	摘要/说明 传输投资人的机构类型 最大长度 60 位
<b>PartyDetailsUpdateGrp</b>						
1676				NoPartyUpdates	1	重复组次数, 固定为 1
→	1324			ListUpdateAction	A	业务代码 枚举值: A-新增 M-修改 D-删除 若为新增的投资人, 填写 A 表示新增; 若投资人信息有更新时, 填写 M 表示修改。
→	<b>PartyDetailGrp</b>					
→	1671			NoPartyDetails	1	重复组次数, 固定为 1
→	→	1691		PartyDetailID	XXX	机构 21 位码 文本, 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构, 固定值
→	→	<b>PartyDetailSubGrp</b>				
→	→	1694		NoPartyDetailSu	6	重复组次数

				bIDs		
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	投资人的中文全称 文本，最大长度 300 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	124	124-机构名称
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	法人代表 文本，最大长度 300 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	4004	4004-法人代表
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	地址 文本，最大长度 300 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	6	6-地址
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	该投资人的第一笔认购/申购/赎回操作时的交易员 填写当天投资人的第一笔认购/申购/赎回操作时的交易员姓名，场务人员填写“-” 文本，最大长度 300 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	101	101-交易员姓名
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	填写该交易员的传真，场务人员填写“-” 最大长度 50 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	4000	4000-传真
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXX	该交易员的电话号码，场务人员填写“-” 文本，最大长度 50 位
→	→	→	1696	PartyDetailSubID	7	7-电话号码

				DType		
StandardTrailer						
10				Checksum	XXX	

5.2.1.3 投资人信息 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8">
<!--
    Description:投资人信息
    PtyDetlDefReq 节点对应投资人信息 IMIX 报文标准中的结构
    PtyDetlDefReqNum 为实际传输的投资人数量
-->
<IMIXML>
    <PtyDetlDefReqList PtyDetlDefReqNum="3">
        <PtyDetlDefReq
            ReqID="XXX"
            TxnTm="20180529-15:08:25"
            Txt="XXX">
            <PtyDetlUpd
                NoPartyUpdates="1"
                ListUpdActn="A">
                <PtyDetl
                    NoPartyDetails="1"
                    R="1"
                    ID="XXX">
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="2" Typ="4004" ID="XXX"/>
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="3" Typ="6" ID="XXX"/>
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="4" Typ="101" ID="XXX"/>
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="5" Typ="4000" ID="XXX"/>
                        <Sub NoPartyDetailSubIDs="6" Typ="7" ID="XXX"/>
                    </PtyDetl>
                </PtyDetlUpd>
            </PtyDetlDefReq>
            <PtyDetlDefReq
                ReqID="XXX"
                TxnTm="20180529-15:08:25"
                Txt="XXX">
                <PtyDetlUpd
                    NoPartyUpdates="1"
                    ListUpdActn="M">
                    <PtyDetl
                        NoPartyDetails="1"
                        R="1"
```

```

ID="XXX">
<Sub NoPartyDetailSubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
<Sub NoPartyDetailSubIDs="2" Typ="4004" ID="XXX"/>
<Sub NoPartyDetailSubIDs="3" Typ="6" ID="XXX"/>
<Sub NoPartyDetailSubIDs="4" Typ="101" ID="XXX"/>
<Sub NoPartyDetailSubIDs="5" Typ="4000" ID="XXX"/>
<Sub NoPartyDetailSubIDs="6" Typ="7" ID="XXX"/>
</PtyDetl>
</PtyDetlUpd>
</PtyDetlDefReq>
<PtyDetlDefReq
  ReqID="XXX"
  TxnTm="20180529-15:08:25"
  Txt="XXX">
  <PtyDetlUpd
    NoPartyUpdates="1"
    ListUpdActn="D">
    <PtyDetl
      NoPartyDetails="1"
      R="1"
      ID="XXX">
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="1" Typ="124" ID="XXX"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="2" Typ="4004" ID="XXX"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="3" Typ="6" ID="XXX"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="4" Typ="101" ID="XXX"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="5" Typ="4000" ID="XXX"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="6" Typ="7" ID="XXX"/>
      </PtyDetl>
    </PtyDetlUpd>
  </PtyDetlDefReq>
  .....
</PtyDetlDefReqList>
</IMIXML>

```

### 5.2.2 认购申购赎回申请

中国外汇交易中心每日9:00-15:00实时增量将当日投资人的认购、申购、赎回信息以xml文件的方式传输给发行人。

另中国外汇交易中心每日15:30会发送全量“认购申购赎回申请”文件给发行人；如果当日没有认申购申请信息，传输空文件。

认购申购赎回申请文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.2.2.1 认购申购赎回申请业务要素

中国外汇交易中心发送认购申购赎回申请，具体业务要素请见表3。



表3 认购申购赎回申请业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
成交编号	17 ExecID	ExecID	是	文本，最大长度 24 位 填写认购/申购/赎回申请单编号
投资状态	150ExecType	ExecTyp	是	枚举值： 0-已投资 4-已撤销 初次提交投资申请时，枚举值传输“0-已投资”，场务应急撤销时，枚举值传输“4-已撤销”
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
交易日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式：YYYYMMDD-HH:SS:MM
交易时间			是	
业务代码	11877 BusinessIdentity	BusinessIdentity	是	枚举值： 031 表示冻结份额 032 表示解冻份额 020 表示认购 022 表示申购 024 表示赎回
结算币种	120SettlCurrency	SettlCcy	是	填写产品发行要素里的结算币种，最大长度 3 位 枚举值：CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
机构 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时， 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本，填写投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
申请模式	12018InvestmentMode	InvestmentMode	条件选填	枚举值： 1-PCF 2-NAV 业务代码为 022 申购和 024 赎回时，传输该字段。 PCF 代表使用 PCF 清单进行实物申赎，实时确认； NAV 代表现金申赎或使用债券清单进行实物申赎，

				当日日终或之后确认。
申赎模式	12019PurchaseOrRedepMode	PurchaseOrRedepMode	是	枚举值： 1-现金申赎 2-实物申赎 指产品发行要素里的申赎模式
申请总预估现金差额	12020TotalEstimatedCashSpread	TotalEstimatedCashSpread	条件选填	按 PCF 清单申购赎回时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
申请总替代金额	12021TotalReplacementAmount	TotalReplacementAmount	条件选填	按 PCF 清单申购赎回时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
申请现金结算总额	119SettlCurrAmt	SettlCurrAmt	条件选填	按 PCF 清单申购时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
申请债券代码	309UnderlyingSecurityID	ID	条件选填	按债券清单申赎或按 PCF 清单申赎时，传输该字段 文本，最大长度 50 位
申请债券券面总额	879UnderlyingQty	Qty	条件选填	按债券清单申赎或按 PCF 清单申赎时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：2
申请替代金额	12022UnderlyingReplacementAmount	UnderlyingReplacementAmount	条件选填	按 PCF 清单申购赎回时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
托管机构	使用 RelatedPartyDetailSubGrp 组件 1568RelatedPartyDetailSubIDType 取值 111 表示托管机构名称 1567RelatedPartyDetailSubID 填写具体值	使用 Sub 组件 Typ=111 时 ID 的值	条件选填	传输中央结算公司或上海清算所； 传输中央结算公司时，代表传输的托管账号的托管机构为中央结算公司； 传输上海清算所时，代表传输的托管账号的托管机构为上海清算所 文本，最大长度 50 位
托管账户名称	使用 RelatedPartyDetailSubGrp	使用 Sub 组件 Typ=22 时 ID 的值	条件选填	结算机构选择中央结算公司或上海清算所时、或者

	<p>组件</p> <p>1568RelatedPartyDetailSubIDType 取值 22 表示托管账户名称,</p> <p>1567RelatedPartyDetailSubID 填写具体值</p>			<p>按债券清单认申赎时、或者按 PCF 清单申赎时, 传输该字段</p> <p>具体传输场景如下:</p> <p>a. 现金认申赎, 结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时, 传输投资人在上海清算所或中央结算公司的托管账户名称;</p> <p>b. 按“债券清单认购/申购/赎回”或“按 PCF 清单申购/赎回”时:</p> <p>1) 如果结算机构为“发行人”, 则传输投资人在债券托管机构的托管账户名称;</p> <p>2) 如果结算机构为“中央结算公司”, 首先, 投资人在中央结算公司的托管账户名称必传; 其次, 传输投资人在债券托管机构的托管账户名称, 如债券托管机构有上海清算所, 则同时传输投资人在上海清算所的托管账户名称; 如果债券托管机构有中央结算公司, 则不再重复传输投资人在中央结算公司的托管账户名称</p> <p>3) 如果结算机构为“上海清算所”, 逻辑同 2) 描述文本, 最大长度 100 位</p>
托管账号	<p>使用 RelatedPartyDetailGroup 组件</p> <p>1565RelatedPartyDetailRole 取值 105 表示托管机构时,</p> <p>1563RelatedPartyDetailID 填写托管账号</p>	使用 ReltdPtyDetl 组件 R=105 时 ID 的值	条件选填	<p>结算机构选择中央结算公司或上海清算所时、或者按债券清单认申赎时、或者按 PCF 清单申赎时, 传输该字段</p> <p>具体传输场景如下:</p> <p>a. 现金认申赎, 结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时, 传输投资人在上海清算所或中央结算</p>

				<p>公司的托管账号；</p> <p>b. 按“债券清单认购/申购/赎回”或“按 PCF 清单申购/赎回”时：</p> <p>1) 如果结算机构为“发行人”，则传输投资人在债券托管机构的托管账号；</p> <p>2) 如果结算机构为“中央结算公司”，首先，投资人在中央结算公司的托管账号必传；其次，传输投资人在债券托管机构的托管账号，如债券托管机构有上海清算所，则同时传输投资人在上海清算所的托管账号；如果债券托管机构有中央结算公司，则不再重复传输投资人在中央结算公司的托管账号</p> <p>3) 如果结算机构为“上海清算所”，逻辑同 2) 描述文本，最大长度 50 位</p>
资金账户户名	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 23 时表示资金账户户名 523PartySubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 Typ=23 时 ID 的值	是	<p>结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时，填写“上海清算所托管账号或中央结算公司托管账号”关联的投资人的资金账户户名；</p> <p>结算机构为“发行人”时，填写投资人选择的资金账户户名</p> <p>文本，最大长度 300 位</p>
资金账号	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 15 时表示资金账号 523PartySubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 Typ=15 时 ID 的值	是	<p>结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时，填写“上海清算所托管账号或中央结算公司托管账号”关联的投资人的资金账号；</p> <p>结算机构为“发行人”时，填写投资人选择的资金账号</p> <p>文本，最大长度 50 位</p>

资金开户行	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 110 时表示资金开户行 523PartySubID 填写具体的 值	使用 Sub 组件 Typ=110 时 ID 的值	否	填写资金账号关联的资金 开户行 如无值, 则不传输或传空 值 文本, 最大长度 300 位
开户行行号	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 112 时表示开户行行号 523PartySubID 填写具体的 值	使用 Sub 组件 Typ=112 时 ID 的值	否	填写资金账号关联的开户 行行号 如无值, 则不传输或传空 值 文本, 最大长度 50 位
申请份数	10848 TransactionNum	TransactionNum	条件选填	赎回时或按 PCF 清单申购 时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
申请金额	10312TradeCashAmt	TradeCashAmt	条件选填	现金认购或现金申购时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 2
交易员姓名	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 101 时表示交易员姓名 523PartySubID 填写具体的 值	使用 Sub 组件 当 Typ=101 时, ID 的值	是	填写交易员的姓名, 场务 人员填写“-” 文本, 最大长度 300 位
电话	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 7 时表示电话号码 523PartySubID 填写具体的 值	使用 Sub 组件 当 Typ=7 时, ID 的值	否	填写交易员的电话, 场务 人员填写“-” 文本, 最大长度 50 位
传真	使用 PtysSubGrp 组件 当 803Party1SubIDType 取值 取值 4000 时表示传真 523PartySubID 填写具体的 值	使用 Sub 组件 当 Typ=4000 时, ID 的值	否	该交易员的传真, 场务人 员填写“-” 文本, 最大长度 50 位
结算日期	64SettlDate	SettlDt	是	格式: YYYYMMDD
跨境标识	11677CrssBorderIndicator	CrssBorderIndicator	是	枚举值: Y-跨境结算 N-非跨境结算 当投资人为债券通机构 时, 填写 Y 表示跨境结算, 否则填写 N 表示非跨境结 算
代理行行号	使用 Parties 组件	使用 Pty 组件	否	当投资人为债券通机构

	当 452 PartyRole=30 时, 448 PartyID 的值	当 R=30 时, ID 的值		时,可能会有代理行行号, 当有多个代理行行号时, 则重复多次该组件进行传 输 文本, 最大长度 50 位
巨额赎回处理 标志	11678RedemptionTransType	RedemptionTransType	是	枚举值: P-顺延 C-取消 目前仅支持取消, 不支持 顺延
巨额购买处理 标志	11679PurchaseTransType	PurchaseTransType	是	枚举值: P-顺延 C-取消 目前仅支持取消, 不支持 顺延
原成交编号	11255 OrigOperateSeqNum	OrigOperateSeqNum	否	长度 24 位 暂不传输该字段
对方机构 21 位 码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=17 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=17 时, ID 的值	否	21 位编码 暂不传输该字段
转换时的目标 产品代码	使用 RelatedInstrumentGrp 组件 当 1648 RelatedInstrumentType=10 0 时表示产品转换, 1650RelatedSecurityID 的 值	使用 ReltdInstrmt 组件 当 InstrmtTyp=100 时, ID 的 值	否	长度 32 位 暂不传输该字段
摘要/说明	58 Text	Txt	否	文本, 最大长度 60 位

#### 5.2.2.2 认购申购赎回申请 IMIX 报文标准

认购申购赎回申请IMIX报文标准见表4。

表4 认购申购赎回申请 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	8	报文类型 8-ExecutionReport
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
57				TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志

34					MsgSeqNum	1	报文序列号
52					SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>							
17					ExecID	XXX	成交编号 文本，最大长度 24 位 填写认购/申购/赎回结算单编号
60					TransactTime	20180512-12:30:00	交易日期、交易时间 格 式： YYYYMMDD-HH:MM:SS
150					ExecType	0	投资状态 枚举值： 0-已投资 4-已撤销 初次提交投资申请时，枚举值传输“0-已投资”，场务应急撤销时，枚举值传输“4-已撤销”
12018					InvestmentMode	1	申请模式 枚举值： 1-PCF 2-NAV 业务代码为 022 申购和 024 赎回时，传输该字段。 PCF 代表使用 PCF 清单进行实物申赎，实时确认； NAV 代表现金申赎或使用债券清单进行实物申赎，当日日终或之后确认。
12019					PurchaseOrRedepMode	1	申赎模式 枚举值： 1-现金申赎 2-实物申赎 指产品发行要素里的申赎模式
12020					TotalEstimatedCashSpread	210000.12	申请总预估现金差额

							按 PCF 清单申购赎回时，传输该字段数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
12021					TotalReplacementAmount	150000.12	申请总替代金额 按 PCF 清单申购赎回时，传输该字段数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
119					SettlCurrAmt	120000.12	申请现金结算总额 按 PCF 清单申购时，传输该字段数值，最大长度 18 位 单位：元，精度：2
11877					BusinessIdentity	020	业务代码 枚举值： 031 表示冻结份额 032 表示解冻份额 020 表示认购 022 表示申购 024 表示赎回
120					SettlCurrency	USD	结算币种 填写产品发行要素里的结算币种，最大长度 3 位 枚举值：CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
10848					TransactionNum	1000	申请份数 赎回时或按 PCF 清单申购时，传输该字段， 数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2



10312					TradeCashAmt	1000	申请金额 现金认购或现金申 购时,传输该字段数 值,最大长度 17 位 单位:元,精度:2
64					SettlDate	20181012	结算日期 格式:YYYYMMDD
11677					CrssBorderIndicator	Y	跨境标识 枚举值: Y-跨境结算 N-非跨境结算 当投资人为债券通 机构时,填写 Y 表示 跨境结算,否则填写 N 表示非跨境结算
11678					RedemptionTransType	P	巨额赎回处理标志 枚举值: P-顺延 C-取消 目前仅支持取消,不 支持顺延
11679					PurchaseTransType	P	巨额购买处理标志 枚举值: P-顺延 C-取消 目前仅支持取消,不 支持顺延
11255					OrigOperateSeqNum	XXX	原成交编号 长度 24 位 暂不传输该字段
58					Text	XXX	摘要/说明 文本,最大长度 60 位
<b>Instrument</b>							
48					SecurityID	XXXX	产品代码 文本,最大长度 32 位
<b>RelatedInstrumentGrp</b>							
1647					NoRelatedInstruments	1	重复组次数
→	1648				RelatedInstrumentType	100	100 表示转换时的 目标产品代码
→	1650				RelatedSecurityID	XXX	填写转换时的目标

							产品代码值 长度 32 位 暂不传输该字段
<b>UndInstrmtGrp</b>							
711					NoUnderlyings	2	重复次数 按债券清单或 PCF 清单投资时传输该 组件
→	311				UnderlyingSymbol	-	必须域, 固定传“-”
→	309				UnderlyingSecurityID	XXX	申请债券代码 按债券清单认申赎 或按 PCF 清单申赎 时, 传输该字段 文本, 最大长度 50 位
→	879				UnderlyingQty	1000000.01	申请债券券面总额 按债券清单认申赎 或按 PCF 清单申赎 时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 2
→	12022				UnderlyingReplacementAmount	12000.13	申请替代金额 按 PCF 清单申购赎 回时, 传输该字段 数值, 最大长度 18 位 单位: 元, 精度: 2
→	311				UnderlyingSymbol	-	必须域, 固定传“-”
→	309				UnderlyingSecurityID	XXX	申请债券代码 按债券清单认申赎 或按 PCF 清单申赎 时, 传输该字段 文本, 最大长度 50 位
→	879				UnderlyingQty	1200000.01	申请债券券面总额 按债券清单认申赎 或按 PCF 清单申赎 时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 2

→	12022				UnderlyingReplacementAmount	12000.14	申请替代金额 按 PCF 清单中购赎 回时, 传输该字段 数值, 最大长度 18 位 单位: 元, 精度: 2
<b>Parties</b>							
453					NoPartyIDs	5	重复组次数
→	448				PartyID	XXX	机构 21 位码 文本, 填写投资人在 中国外汇交易中心 的 21 位编码
→	452				PartyRole	1	1-机构
→	<b>PtysSubGrp</b>						
→	802				NoPartySubIDs	7	重复组次数
→	→	523			PartySubID	XXX	填写交易员的姓名, 场务人员填写“-” 文本, 最大长度 300 位
→	→	803			PartySubIDType	101	101-交易员姓名
→	→	523			PartySubID	XXX	填写该交易员的传 真, 场务人员填写 “-” 文本, 最大长度 50 位
→	→	803			PartySubIDType	4000	4000-传真
→	→	523			PartySubID	XXX	填写交易员的电话, 场务人员填写“-” 文本, 最大长度 50 位
→	→	803			PartySubIDType	7	7-电话号码
→	→	523			PartySubID	XXX	结算机构为“上海清 算所或中央结算公 司”时, 填写“上海 清算所托管账号或 中央结算公司托管 账号”关联的投资人 的资金账户户名; 结算机构为“发行 人”时, 填写投资人 选择的资金账户户

							名 文本, 最大长度 300 位
→	→	803			PartySubIDType	23	23-资金账户户名
→	→	523			PartySubID	XXX	结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时, 填写“上海清算所托管账号或中央结算公司托管账号”关联的投资人的资金账号; 结算机构为“发行人”时, 填写投资人选择的资金账号 文本, 最大长度 50 位
→	→	803			PartySubIDType	15	15-资金账号
→	→	523			PartySubID	XXX	填写资金账号关联的资金开户行 如无值, 则不传输或传空值 文本, 最大长度 300 位
→	→	803			PartySubIDType	110	110-资金开户行
→	→	523			PartySubID	XXX	填写资金账号关联的开户行行号 如无值, 则不传输或传空值 文本, 最大长度 50 位
→	→	803			PartySubIDType	112	112-开户行行号
→	<b>RelatedPartyDetailGrp</b>						
→	1562				NoRelatedPartyDetails	2	
→	→	1563			RelatedPartyDetailID	XXX	托管账号 结算机构选择中央结算公司或上海清算所时、或者按债券清单认申赎时、或者按 PCF 清单申赎时, 传输该字段 具体传输场景如下: a. 现金认申赎, 结算

							机构为“上海清算所或中央结算公司”时,传输投资人在上海清算所或中央结算公司的托管账号; b. 按“债券清单认购/申购/赎回”或“按PCF 清单申购/赎回”时: 1) 如果结算机构为“发行人”,则传输投资人在债券托管机构的托管账号; 2) 如果结算机构为“中央结算公司”,首先,投资人在中央结算公司的托管账号必传;其次,传输投资人在债券托管机构的托管账号,如债券托管机构有上海清算所,则同时传输投资人在上海清算所的托管账号;如果债券托管机构有中央结算公司,则不再重复传输投资人在中央结算公司的托管账号 3) 如果结算机构为“上海清算所”,逻辑同2)描述 文本,最大长度 50 位
→	→	1565			RelatedPartyDetailRole	105	105-托管机构
→	→	RelatedPartyDetailSubGrp					
→	→	1566			NoRelatedPartyDetailSubIDs	2	
→	→	→	1567		RelatedPartyDetailSubID	中央结算公司	传输中央结算公司时,代表传输的托管账号的托管机构为中央结算公司; 文本,最大长度 50

							位
→	→	→	1568		RelatedPartyDetailSubIDType	111	111-托管机构名称
→	→	→	1567		RelatedPartyDetailSubID	XXX	填写托管账户名称 具体值
→	→	→	1568		RelatedPartyDetailSubIDType	22	22-托管账户名称 结算机构选择中央 结算公司或上海清 算所时、或者按债券 清单认申赎时、或者 按 PCF 清单申赎时， 传输该字段 具体传输场景如下： a. 现金认申赎，结算 机构为“上海清算所 或中央结算公司” 时，传输投资人在上 海清算所或中央结 算公司的托管账户 名称； b. 按“债券清单认购 /申购/赎回”或“按 PCF 清单申购/赎 回”时： 1) 如果结算机构为 “发行人”，则传输 投资人在债券托管 机构的托管账户名 称； 2) 如果结算机构为 “中央结算公司”， 首先，投资人在中央 结算公司的托管账 户名称必传；其次， 传输投资人在债券 托管机构的托管账 户名称，如债券托管 机构有上海清算所， 则同时传输投资人在上海清算所的托 管账户名称；如果债 券托管机构有中央 结算公司，则不再重

							复传输投资人在中央结算公司的托管账户名称 3) 如果结算机构为“上海清算所”，逻辑同 2) 描述 文本，最大长度 100 位
→	→	1563			RelatedPartyDetailID	XXX	托管账号 结算机构选择中央结算公司或上海清算所时、或者按债券清单认申赎时、或者按 PCF 清单申赎时，传输该字段 具体传输场景如下： a. 现金认申赎，结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时，传输投资人在上海清算所或中央结算公司的托管账号； b. 按“债券清单认购/申购/赎回”或“按 PCF 清单申购/赎回”时： 1) 如果结算机构为“发行人”，则传输投资人在债券托管机构的托管账号； 2) 如果结算机构为“中央结算公司”，首先，投资人在中央结算公司的托管账号必传；其次，传输投资人在债券托管机构的托管账号，如债券托管机构有上海清算所，则同时传输投资人在上海清算所的托管账号；如果债券托管机构有

							中央结算公司,则不再重复传输投资人在中央结算公司的托管账号 3) 如果结算机构为“上海清算所”,逻辑同 2) 描述 文本, 最大长度 50 位
→	→	1565			RelatedPartyDetailRole	105	105-托管机构
→	→	RelatedPartyDetailSubGrp					
→	→	1566			NoRelatedPartyDetailSubIDs	2	
→	→	→	1567		RelatedPartyDetailSubID	上海清算所	传输上海清算所时,代表传输的托管账号的托管机构为上海清算所 文本, 最大长度 50 位
→	→	→	1568		RelatedPartyDetailSubIDType	111	111-托管机构名称
→	→	→	1567		RelatedPartyDetailSubID	XXX	填写托管账户名称具体值
→	→	→	1568		RelatedPartyDetailSubIDType	22	22-托管账户名称 结算机构选择中央结算公司或上海清算所时、或者按债券清单认申赎时、或者按 PCF 清单申赎时,传输该字段 具体传输场景如下: a. 现金认申赎, 结算机构为“上海清算所或中央结算公司”时,传输投资人在上海清算所或中央结算公司的托管账户名称; b. 按“债券清单认购/申购/赎回”或“按 PCF 清单申购/赎回”时: 1) 如果结算机构为“发行人”, 则传输



							<p>投资人在债券托管机构的托管账户名称;</p> <p>2) 如果结算机构为“中央结算公司”, 首先, 投资人在中央结算公司的托管账户名称必传; 其次, 传输投资人在债券托管机构的托管账户名称, 如债券托管机构有上海清算所, 则同时传输投资人在上海清算所的托管账户名称; 如果债券托管机构有中央结算公司, 则不再重复传输投资人在中央结算公司的托管账户名称</p> <p>3) 如果结算机构为“上海清算所”, 逻辑同 2) 描述</p> <p>文本, 最大长度 100 位</p>
→	448				PartyID	XXX	对方机构 21 位码 暂不传输该字段
→	452				PartyRole	17	17-对方机构
→	448				PartyID	XXX	<p>代理行行号</p> <p>当投资人为债券通机构时, 可能会有代理行行号</p> <p>当有多个代理行行号时, 则重复多次该组件进行传输</p> <p>文本, 最大长度 50 位</p>
→	452				PartyRole	30	30-代理行
→	448				PartyID	XXX	<p>代理行行号</p> <p>当投资人为债券通机构时, 可能会有代</p>

							理行行号 当有多个代理行行号时,则重复多次该组件进行传输 文本, 最大长度 50 位
→	452				PartyRole	30	30-代理行
→	448				PartyID	XXX	代理行行号 当投资人为债券通机构时,可能会有代理行行号 当有多个代理行行号时,则重复多次该组件进行传输 文本, 最大长度 50 位
→	452				PartyRole	30	30-代理行
<b>StandardTrailer</b>							
10					Checksum	XXX	

### 5. 2. 2. 3 认购申购赎回申请 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description: 认购申购赎回申请

ExecRpt 节点对应认购申购赎回申请 IMIX 报文标准中的结构

ExecRptNum 为实际传输的认购申购赎回申请的数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<ExecRptList ExecRptNum="2">
```

```
<ExecRpt
```

```
  ExecID="XXX"
```

```
  TxnTm="20180512-12:30:00"
```

```
  BusinessIdentity="031"
```

```
  SettlCcy="USD"
```

```
  ExecTyp="0"
```

```
  InvestmentMode="1"
```

```
  PurchaseOrRedepMode="1"
```

```
  TotalEstimatedCashSpread="210000.12"
```

```
  TotalReplacementAmount="150000.12"
```

```
  SettlCurrAmt="120000.12"
```

```
  TransactionNum="1000"
```

```

TradeCashAmt="1000"
SettlDt="20181012"
CrssBorderIndicator="Y"
RedemptionTransType="P"
PurchaseTransType="P"
OrigOperateSeqNum="XXXX"
Txt="XXX">
<Instrmt ID="XXX"/>
<ReltdInstrmt NoRelatedInstruments="1" Instrmt Typ="100" ID="XXX"/>
<Undly          NoUnderlyings="1"          Sym="-"          ID="XXX"
Qty="1000000.01" UnderlyingReplacementAmount="12000.13"/>
<Undly          NoUnderlyings="2"          Sym="-"          ID="XXX"
Qty="1200000.01" UnderlyingReplacementAmount="12000.14"/>
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">
  <Sub NoPartySubIDs="1" Typ="101" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="2" Typ="7" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="3" Typ="4000" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="4" Typ="23" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="5" Typ="15" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="6" Typ="110" ID="XXX"/>
  <Sub NoPartySubIDs="7" Typ="112" ID="XXX"/>
  <ReltdPtyDetl NoRelatedPartyDetails="1" ID="XXX" R="105"/>
    <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs="1" ID="中央结算公司" Typ="111"/>
    <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs="2" ID="XXX" Typ="22"/>
  <ReltdPtyDetl NoRelatedPartyDetails="2" ID="XXX" R="105"/>
    <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs="1" ID="上海清算所" Typ="111"/>
    <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs="2" ID="XXX" Typ="22"/>
</Pty>
<Pty NoPartyIDs="2" ID="XXX" R="17"/>
<Pty NoPartyIDs="3" ID="XXX" R="30"/>
<Pty NoPartyIDs="4" ID="XXX" R="30"/>
<Pty NoPartyIDs="5" ID="XXX" R="30"/>
</ExecRpt>
<ExecRpt
  ExecID="XXX"
  TxnTm="20180512-12:30:00"
  BusinessIdentity="031"
  SettlCcy="USD"
  ExecTyp="0"
  InvestmentMode="1"
  PurchaseOrRedepMode="1"
  TotalEstimatedCashSpread="210000.12"
  TotalReplacementAmount="150000.12"

```

```

SettlCurrAmt="120000.12"
TransactionNum="1000"
TradeCashAmt="1000"
SettlDt="20181012"
CrssBorderIndicator="Y"
RedemptionTransType="P"
PurchaseTransType="P"
OrigOperateSeqNum="XXXX"
Txt="XXX">
<Instrmt ID="XXX"/>
<ReltdInstrmt NoRelatedInstruments="1" Instrmt Typ="100" ID="XXX"/>
<Undly          NoUnderlyings="1"          Sym="-"          ID="XXX"
Qty="1000000.01" UnderlyingReplacementAmount="12000.13"/>
<Undly          NoUnderlyings="2"          Sym="-"          ID="XXX"
Qty="1200000.02" UnderlyingReplacementAmount="12000.14"/>
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">
    <Sub NoPartySubIDs="1" Typ="101" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="2" Typ="7" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="3" Typ="4000" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="4" Typ="23" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="5" Typ="15" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="6" Typ="110" ID="XXX"/>
    <Sub NoPartySubIDs="7" Typ="112" ID="XXX"/>
    <ReltdPtyDetl NoRelatedPartyDetails="1" ID="XXX" R="105"/>
        <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs ="1" ID="中央结算公司" Typ="111"/>
        <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs ="2" ID="XXX" Typ="22"/>
    <ReltdPtyDetl NoRelatedPartyDetails="2" ID="XXX" R="105"/>
        <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs ="1" ID="上海清算所" Typ="111"/>
        <Sub NoRelatedPartyDetailSubIDs ="2" ID="XXX" Typ="22"/>
</Pty>
<Pty NoPartyIDs="2" ID="XXX" R="17"/>
<Pty NoPartyIDs="3" ID="XXX" R="30"/>
<Pty NoPartyIDs="4" ID="XXX" R="30"/>
<Pty NoPartyIDs="5" ID="XXX" R="30"/>
</ExecRpt>
.....
</ExecRptList>
</IMIXML>

```

### 5.2.3 新开户资料

中国外汇交易中心8:00-19:00实时增量将当日投资人上传的新开户资料以zip(rar)文件的方式传输给发行人，发行人据此进行开户，并需将开户结果批量传输给中国外汇交易中心。中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里投资人的开户结果信息，如果发行人当日发出开户结果后又接收到

中国外汇交易中心发出的新开户材料、已开户待匹配信息，发行人则需要在次日在开户结果中将以上信息反馈。

另中国外汇交易中心每日19:30会发送全量“新开户资料”清单文件给发行人。如果当日没有“新开户资料”清单文件信息，传输空文件。

新开户资料文件目录结构及命名请见4.4章节。

### 5.2.3.1 新开户资料清单文件业务要素

新开户资料清单文件的具体业务要素请见表5。

表5 新开户资料清单文件业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
投资人机构 21 位码	使用 PartyDetailGrp 组件 1693 PartyDetailRole 取值 1 时 1691PartyDetailID 的值	使用 PtyDet1 组件 R 取值 1 时 ID 的值	是	文本，最大长度 21 位 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
文件数目	12023FileNum	FileNum	是	数字，最大长度 17 位，投资人上传的新开户资料的文件数目，一个 zip(rar) 文件数目为 1。

### 5.2.3.2 新开户资料清单文件 IMIX 报文标准

新开户资料清单文件的IMIX报文标准请见表6。

表6 新开户资料清单文件 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>					
8			BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9			BodyLength	20	报文体长度
35			MsgType	CG	报文类型 CG-PartyDetailsListReport
49			SenderCompID	XXX	报文发送方
56			TargetCompID	XXX	报文接收方
57			TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34			MsgSeqNum	1	报文序列号
52			SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>					
10229			PartyInfoType	a	a-新开户资料清单文件
<b>PartyDetailGrp</b>					
1671			NoPartyDetails	2	

→	1691		PartyDetailID	XXXX	投资人机构 21 位码 文本, 最大长度 21 位 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构
→	12023		FileNum	3	数字, 最大长度 17 位, 投资人上传的新开户资料的文件数目, 一个 zip(rar) 文件数目为 1。
→	1691		PartyDetailID	XXXX	投资人机构 21 位码 文本, 最大长度 21 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构
→	12023		FileNum	4	数字, 最大长度 17 位, 投资人上传的新开户资料的文件数目, 一个 zip(rar) 文件数目为 1。
<b>StandardTrailer</b>					
10			Checksum	XXX	

### 5.2.3.3 新开户资料清单文件 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:新开户资料清单文件

PtyDetlListRpt 节点对应新开户资料清单文件 IMIX 报文标准中的结构, 以 PartyInfoType=a, 标识该消息为新开户资料清单文件信息

由于 PtyDetlListRpt 本身可支持传输多个新开户资料清单文件, 故 PtyDetlListRpt 为最外层节点, 若传输多个新开户资料清单文件, 以 PtyDetl 节点, 传输多个

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<PtyDetlListRpt
```

```

PartyInfoType="a">
<PtyDetl NoPartyDetails="1" ID="XXX" R="1" FileNum="3"/>
<PtyDetl NoPartyDetails="2" ID="XXX" R="1" FileNum="4"/>
.....
</PtyDetlListRpt>
</IMIXML>

```

#### 5.2.4 已开户待匹配信息

投资人已在发行人处开立账户的,中国外汇交易中心8:00-19:00实时增量将当日投资人填写的已开户待匹配信息以xml文件的方式传输给发行人,发行人据此进行匹配确认,并需将匹配确认结果批量传输给中国外汇交易中心,中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里投资人的开户结果信息。

另中国外汇交易中心每日19:30会发送全量“已开户待匹配信息”文件给发行人。如果当日没有已开户待匹配信息,传输空文件。

已开户待匹配信息文件目录结构及命名请见4.4章节。

##### 5.2.4.1 已开户待匹配信息业务要素

中国外汇交易中心发送已开户待匹配信息,具体业务要素请见表7。

表7 已开户待匹配信息业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
开户类型	使用 PartyDetailGrp 组件 12024AccountOpenType	使用 PtyDetl 组件 AccountOpenType	是	枚举值: 1-已开户
投资人机构 21 位码	使用 PartyDetailGrp 组件 1693 PartyDetailRole 取值 1 时 1691PartyDetailID 的值	使用 PtyDetl 组件 R 取值 1 时 ID 的值	是	文本, 最大长度 21 位 投资人在中国外汇交易中心 的 21 位编码
投资人机构中文全称	使用 PartyDetailSubGrp 组 件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 124 时表示机构中文全 称 1695PartyDetailSubID 填 写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 124 时表示机 构中文全称 ID 填写具体的值	是	文本, 最大长度 300 位
基金账号	使用 PartyDetailSubGrp 组 件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 280 时表示基金账号 1695 PartyDetailSubID 填 写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 280 时表示基 金账号 ID 填写具体的值	是	文本, 最大长度 100 位
交易账号	使用 PartyDetailSubGrp 组	使用 Sub 组件	是	文本, 最大长度 100 位

	件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 15 时表示交易账号 1695 PartyDetailSubID 填 写具体的值	当 Typ 取值 15 时表示交易 账号 ID 填写具体的值		
投资人代码	使用 PartyDetailSubGrp 组 件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 232 时表示投资人代码 1695 PartyDetailSubID 填 写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 232 时表示投 资人代码 ID 填写具体的值	是	文本，最大长度 100 位 填写统一社会信用代码等

#### 5.2.4.2 已开户待匹配信息 IMIX 报文标准

已开户待匹配信息IMIX报文标准请见表8。

表8 已开户待匹配信息 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>						
8				BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	CX	报文类型 CX-PartyDetailsDe finitionRequest
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
57				TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34				MsgSeqNum	1	报文序列号
52				SendingTime	20180529-12: 30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>						
12025				PtyDetlDefReqType	1	1-已开户待匹配信 息
<b>PartyDetailsUpdateGrp</b>						
1676				NoPartyUpdates	1	重复组次数，固定为 1
→	1324			ListUpdateAction	-	必须域，固定传 “-”无实际业务含 义
→	<b>PartyDetailGrp</b>					
→	1671			NoPartyDetails	1	



→	→	1691		PartyDetailID	XXXX	投资人机构 21 位码 文本，最大长度 21 投资人在中国外汇 交易中心的 21 位编 码
→	→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构
→	→	12024		AccountOpenType	1	开户类型 枚举值： 1-已开户
→	→	<b>PartyDetailSubGrp</b>				
→	→	1694		NoPartyDetailSubIDs	4	
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXX	
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	124	投资人机构中文全 称 文本，最大长度 300 位
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	280	280-基金账号 文本，最大长度 100 位
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	15	15-交易账号 文本，最大长度 100 位
→	→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	→	1696	PartyDetailSubIDType	232	232-投资人代码 文本，最大长度 100 位 填写统一社会信用 代码等
<b>StandardTrailer</b>						
10				Checksum	XXX	

### 5.2.4.3 已开户待匹配信息 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description: 已开户待匹配信息

PtyDetlDefReq 节点对应已开户待匹配信息 IMIX 报文标准中的结构，以 PtyDetlDefReqType=1，标识该消息为已开户待匹配信息，可传输多个已开户待匹配信息，PtyDetlDefReqNum 为实际传输的已开户待匹配信息数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<PtyDetlDefReqListPtyDetlDefReqNum="2">
```

```
<PtyDetlDefReq
  PtyDetlDefReqType="1">
  <PtyDetlUpd NoPartyUpdates="1" ListUpdActn="-">
    <PtyDetl NoPartyDetails="1" ID="XXX" R="1" AccountOpenType="1">
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="2" ID="XXX" Typ="280"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="3" ID="XXX" Typ="15"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="4" ID="XXX" Typ="232"/>
    </PtyDetl>
  </PtyDetlUpd>
</PtyDetlDefReq>
<PtyDetlDefReq
  PtyDetlDefReqType="1">
  <PtyDetlUpd NoPartyUpdates="1" ListUpdActn="-">
    <PtyDetl NoPartyDetails="1" ID="XXX" R="1" AccountOpenType="1">
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="2" ID="XXX" Typ="280"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="3" ID="XXX" Typ="15"/>
      <Sub NoPartyDetailSubIDs="4" ID="XXX" Typ="232"/>
    </PtyDetl>
  </PtyDetlUpd>
</PtyDetlDefReq>
.....
</PtyDetlDefReqList>
</IMIXML>
```

5.2.5 认购处理结果

中国外汇交易中心在认购结束日日终汇总认购期内认购债券冻结及资金划付情况，供发行人进行认购确认。

认购处理结果文件目录结构及命名请见4.4章节。

5.2.5.1 认购处理结果业务要素

认购处理结果业务要素见表XXX。

表9 认购处理结果业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码
生成日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
投资人 A 21	使用 Parties 组件	使用 Pty 组件	是	文本，填写投资人 A 在中国

位机构代码	当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	当 R=1 时, ID 的值		外汇交易中心的 21 位编码
投资人 A 冻结债券代码	使用 UndInstrmtGrp 组件 309UnderlyingSecurityID	使用 Undly 组件 ID	是	文本, 最大长度 100 位
投资人 A 冻结债券券面总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 879UnderlyingQty	使用 Undly 组件 Qty	是	数值, 最大长度 17 位 单位: 万元, 精度 2
投资人 A 已结算现金金额	119SettlCurrAmt	SettlCurrAmt	是	数值, 最大长度 18 位 单位: 元, 精度 2
投资人 B 21 位机构代码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时, ID 的值	是	文本, 填写投资人 B 在中国 外汇交易中心的 21 位编码
投资人 B 冻结债券代码	使用 UndInstrmtGrp 组件 309UnderlyingSecurityID	使用 Undly 组件 ID	是	文本, 最大长度 100 位
投资人 B 冻结债券券面总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 879UnderlyingQty	使用 Undly 组件 Qty	是	数值, 最大长度 17 位 单位: 万元, 精度 2
投资人 B 已结算现金金额	119SettlCurrAmt	SettlCurrAmt	是	数值, 最大长度 18 位 单位: 元, 精度 2
.....				
备注	58Text	Txt	是	文本, 最大长度 500 位

### 5.2.5.2 认购处理结果 IMIX 报文标准

认购处理结果IMIX报文标准见表XXX。

表10 认购处理结果 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>						
8				BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	y	报文类型 y-SecurityList
34				MsgSeqNum	1	报文序列号
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
57				TargetSubID	XXX	报文接收方子标识
52				SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>						
1470				SecurityListType	106	106 表示认购处理结果信息

60					TransactTime	20180101-12:12:12	生成日期 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
58					Text	XXXX	备注 文本，最大长度 500 位
<b>SecListGrp</b>							
146					NoRelatedSym	2	
→	55				Symbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	48				SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码，由于报文结构原因，一条报文会重复传输相同产品代码值
→	119				SettlCurrAmt	12560.12	投资人 A 已结算现金金额 数值，最大长度 18 位 单位：元，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	投资人 A 21 位机构代码 文本，填写投资人 A 在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 A 冻结债券代码 1
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 A 冻结债券券面总额 1 数值，最大长度 17 位 单位：万元，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 A 冻结债券代码 2
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 A 冻结债券券面总额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	55				Symbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	48				SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位

							一个报文传输一个产品代码，由于报文结构原因，一条报文会重复传输相同产品代码值
→	119				SettlCurrAmt	12560.12	投资人 B 已结算现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	投资人 B 21 位机构代码 文本，填写投资人 B 在中国外汇 交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 B 冻结债券代码 1
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 B 冻结债券券面总额 1 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 B 冻结债券代码 2
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 B 冻结债券券面总额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
<b>StandardTrailer</b>							
10					Checksum	XXX	检验和

### 5.2.5.3 认购处理结果 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:认购处理结果

SecList 节点对应认购处理结果 IMIX 报文标准中的结构，以 ListTyp=106，标识该消息为认购处理结果信息

由于 SecList 本身可支持传输多个投资人的认购处理结果信息，故 SecList 为最外层节点，若传输多个投资人的认购处理结果信息，以 SecL 节点，传输多个

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecList
```

```
ListTyp="106"
```

```
TxnTm="20180101-12:12:12"
```

```
Txt="XXX">
```

```

<SecL NoRelatedSym="1" Sym="-" ID="XXX" SettlCurrAmt="12560.12">
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
  <Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
  <Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
</SecL>
<SecL NoRelatedSym="2" Sym="-" ID="XXX" SettlCurrAmt="12560.12">
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
  <Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
  <Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
</SecL>
.....
</SecList>
</IMIXML>

```

### 5.2.6 认购确认反馈

结算机构根据认购确认数据进行债券过户及资金退回（若有）后，汇总形成实际债券过户及资金退还结果，中国外汇交易中心据此将该结果反馈发行人。

认购确认反馈文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.2.6.1 认购确认反馈业务要素

认购确认反馈业务要素见表XXX。

表11 认购确认反馈业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码
生成日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
投资人 A 21 位机构代码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时， 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本，填写投资人 A 在中国 外汇交易中心的 21 位编码
投资人 A 过 户债券代码	使用 UndInstrmtGrp 组件 309UnderlyingSecurityID	使用 Undly 组件 ID	是	文本，最大长度 100 位
投资人 A 过 户债券券面 总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 879UnderlyingQty	使用 Undly 组件 Qty	是	数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
投资人 A 确 认现金金额	11681ConfirmedAmt	ConfirmedAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
投资人 A 退 还现金金额	12095RefundAmt	RefundAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
投资人 B 21	使用 Parties 组件	使用 Pty 组件	是	文本，填写投资人 B 在中国

位机构代码	当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	当 R=1 时, ID 的值		外汇交易中心的 21 位编码
投资人 B 过 户债券代码	使用 UndInstrmtGrp 组件 309UnderlyingSecurityID	使用 Undly 组件 ID	是	文本, 最大长度 100 位
投资人 B 过 户债券券面 总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 879UnderlyingQty	使用 Undly 组件 Qty	是	数值, 单位: 万元 最大长度 17 位, 精度 2
投资人 B 确 认现金金额	11681ConfirmedAmt	ConfirmedAmt	是	数值, 单位: 元 最大长度 18 位, 精度 2
投资人 B 退 还现金金额	12095RefundAmt	RefundAmt	是	数值, 单位: 元 最大长度 18 位, 精度 2
.....				
备注	58Text	Txt	是	文本, 最大长度 500 位

### 5.2.6.2 认购确认反馈 IMIX 报文标准

认购确认反馈IMIX报文标准见表XXX。

表12 认购确认反馈 IMIX 报文标准

域号					域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>							
8					BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9					BodyLength	20	报文体长度
35					MsgType	y	报文类型 y-SecurityList
34					MsgSeqNum	1	报文序列号
49					SenderCompID	XXX	报文发送方
56					TargetCompID	XXX	报文接收方
57					TargetSubID	XXX	报文接收方子标识
52					SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>							
1470					SecurityListType	107	107 表示认购确认反馈信息
60					TransactTime	20180101-12:12:12	生成日期 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
58					Text	XXXX	备注 文本, 最大长度 500 位
<b>SecListGrp</b>							
146					NoRelatedSym	2	
→	55				Symbol	-	必须域, 固定传“-” 无实际业务含义

→	48				SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码，由于报文结构原因，一条报文会重复传输相同产品代码值
→	11681				ConfirmedAmt	14520.13	投资人 A 确认现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	12095				RefundAmt	15420.12	投资人 A 退还现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	文本，填写投资人 A 在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 A 过户债券代码 1
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 A 过户债券券面总额 1 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 A 过户债券代码 2
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 A 过户债券券面总额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	55				Symbol	-	必须域，固定传“-” 无实际业务含义
→	48				SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码，由于报文结构原因，一条报文会重复传输相同产品代码值
→	11681				ConfirmedAmt	14520.13	投资人 B 确认现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	12095				RefundAmt	15420.12	投资人 B 退还现金金额 数值，单位：元



							最大长度 18 位，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	文本，填写投资人 B 在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 B 过户债券代码 1
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 B 过户债券券面总额 1 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	309			UnderlyingSecurityID	XXX	投资人 B 过户债券代码 2
→	→	879			UnderlyingQty	121212.15	投资人 B 过户债券券面总额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
<b>StandardTrailer</b>							
10					Checksum	XXX	检验和

### 5.2.6.3 认购确认反馈 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:认购确认反馈

SecList 节点对应认购确认反馈 IMIX 报文标准中的结构，以 ListTyp=107，标识该消息为认购确认反馈信息

由于 SecList 本身可支持传输多个投资人的认购确认反馈信息，故 SecList 为最外层节点，若传输多个投资人的认购确认反馈信息，以 SecL 节点，传输多个

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecList
```

```
ListTyp="107"
```

```
TxnTm="20180101-12:12:12"
```

```
Txt="XXX">
```

```
<SecL NoRelatedSym="1" Sym="-" ID="XXX" ConfirmedAmt="14520.13" RefundAmt="15420.12">
```

```
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
```

```
</SecL>
```

```
<SecL NoRelatedSym="2" Sym="-" ID="XXX" ConfirmedAmt="14520.13" RefundAmt="15420.12">
```

```

<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="121212.15"/>
</SecL>
.....
</SecList>
</IMIXML>

```

### 5.2.7 持有人份额对账

中国外汇交易中心将持有人份额对账信息在工作日日终批量传输给发行人,发行人据此登记持有人的产品份额。

持有人份额对账文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.2.7.1 持有人份额对账业务要素

持有人份额对账业务要素见表XXX。

表13 持有人份额对账业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本, 最大长度 32 位
持有人 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时, ID 的值	是	文本 投资人在中国外汇交易中心 的 21 位编码
日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS 截取前八位
产品总份数 (含 冻结)	11674 TotSecurityNum	TotSecurityNum	是	数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
可用份数	11951 AvaSecurityNum	AvaSecurityNum	是	数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
冻结份数	11952 FreezeSecurityNum	FreezeSecurityNum	是	数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2

#### 5.2.7.2 持有人份额对账 IMIX 报文标准

持有人份额对账IMIX报文标准见表XXX。

表14 持有人份额对账 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	AK	报文类型 AK-Confirmation

49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
773		ConfirmType	109	取值 109 标识该报文为持有人份额对账
60		TransactTime	20191012-12:12:12	格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS 截取前八位表示日期
11674		TotSecurityNum	152.01	产品总份数(含冻结) 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
11951		AvaSecurityNum	145.02	可用份数 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
11952		FreezeSecurityNum	56.02	冻结份数 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXXX	产品代码 文本, 最大长度 32 位
<b>Parties</b>				
453		NoPartyIDs	1	重复组次数
→	448	PartyID	XXXX	持有人 21 位码 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	452	PartyRole	1	1-机构
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	校验和

### 5.2.7.3 持有人份额对账 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:持有人份额对账

Cnfm 节点对应持有人份额对账 IMIX 报文标准中的结构, CnfmTyp=109 为固定值, 用于标识该消息为持有人份额对账, 其中 Cnfm 为最外层节点, 可根据 Cnfm 节点传输多个持有人份额对账消息。

CnfmNum 为实际传输的持有人份额对账的数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<CnfmList CnfmNum="2">
```

```

<Cnfm
  CnfmTyp="109"
  TxnTm="20191012-12:12:12"
  TotSecurityNum="152.01"
  AvaSecurityNum="145.02"
  FreezeSecurityNum="56.02">
  <Instrmt ID="XXXX"/>
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXXX" R="1"/>
</Cnfm>
<Cnfm
  CnfmTyp="109"
  TxnTm="20191012-12:12:12"
  TotSecurityNum="152.01"
  AvaSecurityNum="145.02"
  FreezeSecurityNum="56.02">
  <Instrmt ID="XXXX"/>
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXXX" R="1"/>
</Cnfm>
.....
</CnfmList>
</IMIXML

```

### 5.3 发行人向中国外汇交易中心传输信息

#### 5.3.1 产品持仓信息

发行人可传输全量更新的产品持仓信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里的当前持仓明细和历史持仓明细相关字段。不更新持仓信息时，不要传输此文件。

产品持仓文件目录结构及命名请见4.4章节。

##### 5.3.1.1 产品持仓信息业务要素

中国外汇交易中心接收指数产品持仓信息，具体业务要素请见表9。

表15 产品持仓信息业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
持仓日期	60 TransactTime	TxnTm	是	格式：YYYYMMDD-HH:mm:ss， 截取前 8 位
资产类型	使用 UnderlyingInstrument 组件 11671 UnderlyingProductComplex	使用 Undly 组件 UnderlyingProductComplex	是	最大长度 2 位 枚举值： 01 表示债券 02 表示存款 03 表示货币市场工具

				04 表示衍生品 05 表示其他
资产代码	使用 UnderlyingInstrument 组件 309 UnderlyingSecurityID	使用 Undly 组件 ID	是	资产类型为债券时, 为债券代码; 资产类型不为债券时, 为自由格式文本 文本, 最大长度 32 位
资产简称	使用 UnderlyingInstrument 组件 311 UnderlyingSymbol	使用 Undly 组件 Sym	是	资产类型为债券时, 为债券简称; 资产类型不为债券时, 为自由格式文本 文本, 最大长度 100 位
资产交易市场	使用 UnderlyingInstrument 组件 11673UnderlyingTrdMarket	使用 Undly 组件 UnderlyingTrdMarket	是	最大长度 2 位 枚举值: 01 表示银行间市场 02 表示上海证券交易所 03 表示深圳证券交易所 04 表示其他
资产币种	使用 UnderlyingInstrument 组件 318 UnderlyingCurrency	使用 Undly 组件 Ccy	是	最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
资产份额	使用 UnderlyingInstrument 组件 879 UnderlyingQty	使用 Undly 组件 Qty	是	当资产类型为其他时, 该字段为 0 数值, 最大长度 32 位 单位: 份, 精度: 2
资产面额	使用 UnderlyingInstrument 组件 10326 UnderlyingFaceValue	使用 Undly 组件 UnderlyingFaceValue	是	填写资产的名义总金额, 资产面额=资产份额*资产单位面值。 当资产类型为债券时, 资产单位面值一般为 100; 当资产类型不为债券时, 资产单位面值等于 1 数值, 最大长度 32 位 单位: 元, 精度: 2
摊余成本	使用 UnderlyingInstrument 组件 11672UnderlyingAmortizedCost	使用 Undly 组件 UnderlyingAmortizedCost	否	填写资产的总摊余成本 (若有) 数值, 最大长度 32 位 单位: 元, 精度: 2
应计利息	使用 UndInstrmtGrp 组件 10321UnderlyingAccruedInte	使用 Undly 组件 UnderlyingAccruedInteres	是	填写每份资产的应计利息 当资产类型不为“01”时, 该

	restAmt	tAmt		字段填为 0 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：4
公允价值（净价）	使用 UnderlyingInstrument 组件 810 UnderlyingPx	使用 Undly 组件 Px	是	填写每份资产的公允价值净价 当资产类型不为“01”时，该字段填为 0 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：4
资产总值	使用 UnderlyingInstrument 组件 11670 UnderlyingTotalAmt	使用 Undly 组件 UnderlyingTotalAmt	是	填写资产的总估值金额 当资产类型为“01”时，资产总值需等于（应计利息+公允价值（净价））*资产份额，可以为负数； 当资产类型不为“01”时，资产总值=资产面额=摊余成本； 数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
占净值比例	使用 UnderlyingInstrument 组件 1045 UnderlyingFXRate	使用 Undly 组件 FxRate	是	填写资产总值占产品资产总净值（产品规模）的比例，可能为负数 数值，最大长度 9 位 单位：%，精度：2

### 5.3.1.2 产品持仓信息 IMIX 报文标准

产品持仓信息IMIX报文标准见表10。

表16 产品持仓信息 IMIX 报文标准

域号	域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>			
8	BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9	BodyLength	20	报文体长度
35	MsgType	d	报文类型 d-SecurityDefinition
49	SenderCompID	XXX	报文发送方
56	TargetCompID	XXX	报文接收方
57	TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34	MsgSeqNum	1	报文序列号
52	SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>			
11272	SecurityDefinitionType	15	取值 15 标识该报文为

				产品持仓信息
60		TransactTime	20180529-12:30:03	持仓日期 格 式 : YYYYMMDD-HH:mm:ss,截 取前 8 位
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXXX	产品代码 文本, 最大长度 32 位
<b>UndInstrmtGrp</b>				
711		NoUnderlyings	3	重复组次数, 表示资产 信息数目
→	311	UnderlyingSymbol	XXX	资产简称 资产类型为债券时, 为 债券简称; 资产类型不 为债券时, 为自由格式 文本 文本, 最大长度 100 位
→	10321	UnderlyingAccruedInterestAmt	10.596	应计利息 填写每份资产的应计利 息 当资产类型不为“01” 时, 该字段填为 0 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 4
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	资产代码 资产类型为债券时, 为 债券代码; 资产类型不 为债券时, 为自由格式 文本 文本, 最大长度 32 位
→	11671	UnderlyingProductComplex	01	资产类型 最大长度 2 位 枚举值: 01 表示债券 02 表示存款 03 表示货币市场工具 04 表示衍生品 05 表示其他
→	11673	UnderlyingTrdMarket	01	资产交易市场 最大长度 2 位 枚举值: 01 表示银行间市场

				02 表示上海证券交易所 03 表示深圳证券交易所 04 表示其他
→	318	UnderlyingCurrency	USD	资产币种 最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
→	879	UnderlyingQty	800	资产份额 当资产类型为其他时, 该字段为 0 数值, 最大长度 32 位 单位: 份, 精度: 2
→	10326	UnderlyingFaceValue	90	资产面额 填写资产的名义总金额, 资产面额=资产份额*资产单位面值。 当资产类型为债券时, 资产单位面值一般为 100; 当资产类型不为债券时, 资产单位面值等于 1 数值, 最大长度 32 位 单位: 元, 精度: 2
→	810	UnderlyingPx	1000.8596	公允价值(净价) 填写每份资产的公允价值净价 当资产类型不为“01”时, 该字段填为 0 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 4
→	11672	UnderlyingAmortizedCost	500	摊余成本 填写资产的总摊余成本(若有) 数值, 最大长度 32 位 单位: 元, 精度: 2



→	11670	UnderlyingTotalAmt	200.39	<p>资产总值</p> <p>填写资产的总估值金额</p> <p>当资产类型为“01”时，资产总值需等于（应计利息+公允价值（净价））*资产份额，可以为负数；</p> <p>当资产类型不为“01”时，资产总值=资产面额=摊余成本；</p> <p>数值，最大长度 32 位</p> <p>单位：元，精度：2</p>
→	1045	UnderlyingFXRate	30.45	<p>占净值比例</p> <p>填写资产总值占产品资产总净值（产品规模）的比例，可能为负数</p> <p>数值，最大长度 9 位</p> <p>单位：%，精度：2</p>
→	311	UnderlyingSymbol	XXX	<p>资产简称</p> <p>资产类型为债券时，为债券简称；资产类型不为债券时，为自由格式文本</p> <p>文本，最大长度 100 位</p>
→	10321	UnderlyingAccruedInterestAmt	10.596	<p>应计利息</p> <p>填写每份资产的应计利息</p> <p>当资产类型不为“01”时，该字段填为 0</p> <p>数值，最大长度 17 位</p> <p>单位：元，精度：4</p>
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	<p>资产代码</p> <p>资产类型为债券时，为债券代码；资产类型不为债券时，为自由格式文本</p> <p>文本，最大长度 32 位</p>
→	11671	UnderlyingProductComplex	01	<p>资产类型</p> <p>最大长度 2 位</p> <p>枚举值：</p> <p>01 表示债券</p> <p>02 表示存款</p>

				03 表示货币市场工具 04 表示衍生品 05 表示其他
→	11673	UnderlyingTrdMarket	01	资产交易市场 最大长度 2 位 枚举值: 01 表示银行间市场 02 表示上海证券交易所 03 表示深圳证券交易所 04 表示其他
→	318	UnderlyingCurrency	USD	资产币种 最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、 EUR、JPY、HKD、GBP、 AUD、NZD、SGD、CHF、 CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、 HUF、PLN、DKK、SEK、 NOK、TRY、MXN、THB
→	879	UnderlyingQty	800	资产份额 当资产类型为其他时, 该字段为 0 数值, 最大长度 32 位 单位: 份, 精度: 2
→	10326	UnderlyingFaceValue	90	资产面额 填写资产的名义总金额, 资产面额=资产份额 *资产单位面值。 当资产类型为债券时, 资产单位面值一般为 100; 当资产类型不为债 券时, 资产单位面值等 于 1 数值, 最大长度 32 位 单位: 元, 精度: 2
→	810	UnderlyingPx	1000.8596	公允价值(净价) 填写每份资产的公允价 值净价 当资产类型不为“01” 时, 该字段填为 0

				数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：4
→	11672	UnderlyingAmortizedCost	500	摊余成本 填写资产的总摊余成本 (若有) 数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
→	11670	UnderlyingTotalAmt	200.39	资产总值 填写资产的总估值金额 当资产类型为“01”时， 资产总值需等于(应计 利息+公允价值(净价)) *资产份额，可以为负 数； 当资产类型不为“01” 时，资产总值=资产面额 =摊余成本； 数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
→	1045	UnderlyingFXRate	30.45	占净值比例 填写资产总值占产品资 产总净值(产品规模) 的比例，可能为负数 数值，最大长度 9 位 单位：%，精度：2
→	311	UnderlyingSymbol	XXX	资产简称 资产类型为债券时，为 债券简称；资产类型不 为债券时，为自由格式 文本 文本，最大长度 100 位
→	10321	UnderlyingAccruedInterestAmt	10.596	应计利息 填写每份资产的应计利 息 当资产类型不为“01” 时，该字段填为 0 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：4
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	资产代码 资产类型为债券时，为 债券代码；资产类型不 为债券时，为自由格式

				文本 文本, 最大长度 32 位
→	11671	UnderlyingProductComplex	02	资产类型 最大长度 2 位 枚举值: 01 表示债券 02 表示存款 03 表示货币市场工具 04 表示衍生品 05 表示其他
→	11673	UnderlyingTrdMarket	01	资产交易市场 最大长度 2 位 枚举值: 01 表示银行间市场 02 表示上海证券交易所 03 表示深圳证券交易所 04 表示其他
→	318	UnderlyingCurrency	USD	资产币种 最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、 EUR、JPY、HKD、GBP、 AUD、NZD、SGD、CHF、 CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、 HUF、PLN、DKK、SEK、 NOK、TRY、MXN、THB
→	879	UnderlyingQty	800	资产份额 当资产类型为其他时, 该字段为 0 数值, 最大长度 32 位 单位: 份, 精度: 2
→	10326	UnderlyingFaceValue	90	资产面额 填写资产的名义总金额, 资产面额=资产份额 *资产单位面值。 当资产类型为债券时, 资产单位面值一般为 100; 当资产类型不为债 券时, 资产单位面值等 于 1

				数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
→	810	UnderlyingPx	1000.8596	公允价值（净价） 填写每份资产的公允价值净价 当资产类型不为“01”时，该字段填为 0 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：4
→	11672	UnderlyingAmortizedCost	500	摊余成本 填写资产的总摊余成本（若有） 数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
→	11670	UnderlyingTotalAmt	200.39	资产总值 填写资产的总估值金额 当资产类型为“01”时，资产总值需等于（应计利息+公允价值（净价））*资产份额，可以为负数； 当资产类型不为“01”时，资产总值=资产面额=摊余成本； 数值，最大长度 32 位 单位：元，精度：2
→	1045	UnderlyingFXRate	30.45	占净值比例 填写资产总值占产品资产总净值（产品规模）的比例，可能为负数 数值，最大长度 9 位 单位：%，精度：2
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.1.3 产品持仓信息 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:产品持仓信息

SecDef 节点对应产品持仓信息 IMIX 报文标准中的结构，以 SecurityDefinitionType=15，标识该消息为产品持仓信息  
可传输多个产品持仓信息，SecDefNum 为实际传输的产品持仓数量

```
-->
```

&lt;IMIXML&gt;

&lt;SecDefList SecDefNum="2"&gt;

&lt;SecDef

SecurityDefinitionType="15"

TxnTm="20180529-12:30:03"&gt;

&lt;InstrmtID="XXXX"/&gt;

&lt;UndlyNoUnderlyings="1"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596"&gt;

&lt;Undly

ID="XXX"

Sym="XXXX"

UnderlyingProductComplex="01"

UnderlyingTrdMarket="01"

Ccy="USD"

Qty="800"

UnderlyingFaceValue="90"

Px="1000"

UnderlyingAmortizedCost="500"

UnderlyingTotalAmt=C200.39m

FxRate=i30.45a

</Undly>

<UndlyNoUnderlyings="2"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596">

<Undly

ID="XXX"

Sym="XXXX"

UnderlyingProductComplex="01"

UnderlyingTrdMarket="01"

Ccy="USD"

Qty="800"

UnderlyingFaceValue="90"

Px="1000"

UnderlyingAmortizedCost="500"

UnderlyingTotalAmt="200.39"

FxRate="30.45"

</Undly>

<UndlyNoUnderlyings="3"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596">

<Undly

ID="XXX"

Sym="XXXX"

UnderlyingProductComplex="02"

UnderlyingTrdMarket="01"

Ccy="USD"

58

```

        Qty="800"
        UnderlyingFaceValue="90"
        Px="1000"
        UnderlyingAmortizedCost="500"
        UnderlyingTotalAmt="200.39"
        FxRate="30.45"
    />
</Undly>
.....
</SecDef>
<SecDef
    SecurityDefinitionType="15"
    TxnTm ="20180529-12:30:03">
        <Instrmt ID="XXXX"/>
        <UndlyNoUnderlyings="1"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596">
            <Undly
                ID="XXX"
                Sym="XXXX"
                UnderlyingProductComplex="01"
                UnderlyingTrdMarket="01"
                Ccy="USD"
                Qty="800"
                UnderlyingFaceValue="90"
                Px="1000"
                UnderlyingAmortizedCost="500"
                UnderlyingTotalAmt="200.39"
                FxRate="30.45"
            />
        </Undly>
        <UndlyNoUnderlyings="2"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596">
            <Undly
                ID="XXX"
                Sym="XXXX"
                UnderlyingProductComplex="01"
                UnderlyingTrdMarket="01"
                Ccy="USD"
                Qty="800"
                UnderlyingFaceValue="90"
                Px="1000"
                UnderlyingAmortizedCost="500"
                UnderlyingTotalAmt="200.39"
                FxRate="30.45"
            />
        </Undly>
    </SecDef>

```

```
</Undly>
<UndlyNoUnderlyings="3"UnderlyingAccruedInterestAmt="10.596">
  <Undly
    ID="XXX"
    Sym="XXXX"
    UnderlyingProductComplex="02"
    UnderlyingTrdMarket="01"
    Ccy="USD"
    Qty="800"
    UnderlyingFaceValue="90"
    Px="1000"
    UnderlyingAmortizedCost="500"
    UnderlyingTotalAmt="200.39"
    FxRate="30.45"
  />
</Undly>
.....
</SecDef>
.....
</SecDefList>
</IMIXML>
```

5.3.2 产品净值

每日日终在固定时间范围内发行人传输全量更新的产品净值信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里的单位净值、产品总份数、产品规模等字段。

产品净值文件目录结构及命名请见4.4章节。

5.3.2.1 产品净值业务要素

中国外汇交易中心接收指数产品净值，具体业务要素请见表11。

表17 产品净值业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	需与货币及债务工具发行系统里的产品代码一致 文本，最大长度 32 位
产品中文全称	使用 Instrument 组件 55 Symbol	使用 Instrmt 组件 Sym	否	选填，如填写则需与货币及债务工具发行系统里产品代码对应的产品全称一致 文本，最大长度 40 位
产品总份数	11674 TotSecurityNum	TotSecurityNum	否	数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2



产品单位净值	使用 ComplexEvents 组件 1486 ComplexEventPrice	使用 CmplxEvnt 组件 Px	条件必填	净值型产品必填 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
产品净值日期	使用 ComplexEvents 组件 11676ComplexEventDate	使用 CmplxEvnt 组件 ComplexEventDate	条件必填	净值型产品必填 格式：YYYYMMDD
净值类型	使用 ComplexEvents 组件 1484 ComplexEventType	使用 CmplxEvnt 组件 Typ	条件必填	净值型产品必填 枚举值： 104-普通净值 105-申购净值 106-赎回净值 目前仅支持传输 104-普通 净值
累计产品单位 净值	11675TotalNetAmt	TotalNetAmt	条件必填	净值型产品必填数值，最 大长度 8 位 单位：元，精度：4
产品规模	32LastQty	LastQty	条件必填	净值型产品必填 产品规模=产品单位净值* 产品总份数 数值，最大长度 16 位 单位：元，精度：2
结算币种	120 SettlCurrency	SettlCcy	是	最大长度 3 位 枚举值为：CNY、USD、EUR、 JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、 SGD、CHF、CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、 PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、 MXN、THB

### 5.3.2.2 产品净值 IMIX 报文标准

产品净值IMIX报文标准见表12。

表18 产品净值 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	d	报文类型 d-SecurityDefinition
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志

34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
11272		SecurityDefinitionType	16	取值 16 标识该报文为产品净值
11674		TotSecurityNum	300	产品总份数 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
11675		TotalNetAmt	100	累计产品单位净值 净值型产品必填 数值, 最大长度 8 位 单位: 元, 精度: 4
32		LastQty	5400	产品规模 净值型产品必填 产品规模=产品单位净值*产品总份数 数值, 最大长度 16 位 单位: 元, 精度: 2
120		SettlCurrency	USD	结算币种 最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
<b>Instrument</b>				
55		Symbol	XXX	产品中文全称 选填, 如填写则需与货币及债务工具发行系统里产品代码对应的产品全称一致 文本, 最大长度 40 位
48		SecurityID	XXXX	产品代码 需与货币及债务工具发行系统里的产品代码一致 文本, 最大长度 32 位
1483		NoComplexEvents	3	重复组次数, 表示净值类型信息数目
→	1484	ComplexEventType	104	净值类型

				净值型产品必填 枚举值： 104-普通净值 105-申购净值 106-赎回净值 目前仅支持传输 104-普通净值
→	1486	ComplexEventPrice	2.04	产品单位净值 净值型产品必填 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
→	11676	ComplexEventDate	20180424	产品净值日期 净值型产品必填 格式：YYYYMMDD
→	1484	ComplexEventType	105	净值类型 净值型产品必填 枚举值： 104-普通净值 105-申购净值 106-赎回净值 目前仅支持传输 104-普通净值
→	1486	ComplexEventPrice	4.56	产品单位净值 净值型产品必填 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
→	11676	ComplexEventDate	20180425	产品净值日期 净值型产品必填 格式：YYYYMMDD
→	1484	ComplexEventType	106	净值类型 净值型产品必填 枚举值： 104-普通净值 105-申购净值 106-赎回净值 目前仅支持传输 104-普通净值
→	1486	ComplexEventPrice	3.67	产品单位净值 净值型产品必填 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
→	11676	ComplexEventDate	20180426	产品净值日期

				净值型产品必填 格式: YYYYMMDD
StandardTrailer				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.2.3 产品净值 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:产品净值

SecDef 节点对应产品净值 IMIX 报文标准中的结构, 以 SecurityDefinitionType=16, 标识该消息为产品净值, 可传输多个产品净值, SecDefNum 为实际传输的产品净值数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecDefList SecDefNum="2">
```

```
<SecDef
```

```
SecurityDefinitionType="16"
```

```
TotalNetAmt ="100"
```

```
TotSecurityNum ="300"
```

```
LastQty ="5400"
```

```
SettlCcy ="USD">
```

```
<Instrmt ID="XXXX" Sym ="XXX">
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="1" Typ="104" Px="2.04" ComplexEventDate="20180424"/>
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="2" Typ="105" Px="4.56" ComplexEventDate="20180425"/>
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="3" Typ="106" Px="3.67" ComplexEventDate="20180426"/>
```

```
</Instrmt>
```

```
</SecDef>
```

```
<SecDef
```

```
SecurityDefinitionType="16"
```

```
TotalNetAmt ="100"
```

```
TotSecurityNum ="300"
```

```
LastQty ="5400"
```

```
SettlCcy ="USD">
```

```
<Instrmt ID="XXXX" Sym ="XXX">
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="1" Typ="104" Px="2.04" ComplexEventDate="20180424"/>
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="2" Typ="105" Px="4.56" ComplexEventDate="20180425"/>
```

```
<CmplxEvntNoComplexEvents="3" Typ="106" Px="3.67" ComplexEventDate="20180426"/>
```

```
</Instrmt>
```

```
</SecDef>
```

```
.....
```

```
</SecDefList>
```

```
</IMIXML>
```

### 5.3.3 认购申购赎回确认

发行人全量传输认购/申赎申请的份额确认结果给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统据此更新确认份数、确认金额、确认单位净值、确认手续费、确认时间等字段。

认购申购赎回确认文件目录结构及命名请见4.4章节。

### 5.3.3.1 认购申购赎回确认业务要素

中国外汇交易中心接收认购申购赎回确认，具体业务要素请见表13。

表19 认购申购赎回确认业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
流水号	使用 ApplicationSequenceControl 组件 1181 ApplSeqNum	使用 ApplSeqCtrl 组件 ApplSeqNum	是	文本，填写数字，最大长度 24 位
成交编号	17 ExecID	ExecID	条件必填	中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统生成的认购/申购/赎回申请单编号 业务代码为 130、122、124 时，该字段必传，且需与认购申购赎回申请中的成交编号保持一致；业务代码为其他代码时，该字段不传。 文本，最大长度 24 位
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	ID	是	需与中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统里的产品代码一致 文本，最大长度 32 位
交易确认日期	10795CnfmTime	CnfmTime	是	指认购、申购、赎回确认份额的日期或份额强制、强减及产品到期兑付的日期 格 式： YYYYMMDD-HH:SS:MM，截取前八位
交易发生日期	10639 SubmitTime	SubmitTime	是	认购、申购、赎回确认时，需填写为投资人的申请时间；份额强制、强减及产品到期兑付时，需填写为具体发生时间 格式：YYYYMMDD-HH:SS:MM
交易发生时间				
业务代码	11877 BusinessIdentity	BusinessIdentity	是	枚举值：

				130 表示认购确认 122 表示申购确认 124 表示赎回确认 144 表示份额强制调增 145 表示份额强制调减 151 表示产品到期兑付
结算币种	120SettlCurrency	SettlCcy	是	最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
机构 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时, ID 的值	是	文本 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
机构中文全称	使用 PtysSubGrp 组件 当 803PartySubIDType 取值 124 时表示机构中文全称 523PartySubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ=124 时, ID 的值	否	文本, 最大长度 300 位 投资人在中国外汇交易中心的中文全称
交易确认份数	11680 ConfirmedNum	ConfirmedNum	是	1) 业务代码为 130 时, 填写包含认购期利息但扣除了手续费后确认的总份额; 2) 业务代码为 122 时, 填写扣除手续费后确认的总份额; 3) 业务代码为 124 时, 填写交易确认份额; 4) 业务代码为 144 或 145 时, 填写调增、调减的交易确认份数; 5) 业务代码为 151 时, 填写到期兑付的总份额。 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
交易确认金额	11681 ConfirmedAmt	ConfirmedAmt	条件选填	1) 业务代码为 130 时, 填写认购扣除手续费后的确认金额, 不包含认购期利息; 2) 业务代码为 122 且申请

				模式为 NAV 时, 填写申购扣除手续费后的确认金额 3) 业务代码为 124 且申请模式为 NAV 时, 填写扣除赎回手续费的结算金额; 4) 业务代码为 144 和 145 时, 填写为 0; 5) 业务代码为 151 时, 填写到期兑付的总金额; 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 2
交易确认债券代码	12047UnderlyingCnfmSecurityID	UnderlyingCnfmSecurityID	条件选填	按债券清单认购/申购/赎回时, 传输该字段 文本, 最大长度 100 位
交易确认债券券面总额	12026UnderlyingCnfmQty	UnderlyingCnfmQty	条件选填	按债券清单认购/申购/赎回时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 精度: 2, 单位: 万元
交易确认债券结算金额	12027UnderlyingCnfmSettlCurrAmt	UnderlyingCnfmSettlCurrAmt	条件选填	按债券清单认购/申购/赎回时, 传输该字段 数值, 最大长度 18 位 精度: 2, 单位: 元
申请债券代码	309UnderlyingSecurityID	ID	条件选填	按债券清单认申购时, 传输该字段 文本, 最大长度 100 位
申请债券券面总额	879UnderlyingQty	Qty	条件选填	按债券清单认申购时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 精度: 2, 单位: 万元
申请份数	10848 TransactionNum	TransactionNum	条件选填	赎回时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
申请金额	10312TradeCashAmt	TradeCashAmt	条件选填	现金认购或现金申购时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 单位: 元, 精度: 2
交易处理返回代码	150 ExecType	ExecTyp	是	枚举值: F-成功 8-失败 认购、申购、赎回结算失败时, 填写为 8-失败, 此时交易确认份数和交易确

				认金额均填写为 0
出错详细信息	1328 RejectText	RejTxt	否	文本，最大长度 100 位
业务过程完全结束标识	11944CompletedIndicator	CompletedIndicator	是	枚举值： N-否 Y-是 当一笔业务成交进行多次确认时，在未完全结束时，填写 N； 当业务完全结束，填写 Y；
手续费	使用 CommissionData 组件 12 Commission	使用 Comm 组件 Comm	是	认购、申购、赎回确认时 发行人收取的价内手续费 （指手续费不单独收，直接在申请现金金额或申请债券折算成的现金金额里扣除），若无价内手续费则填写为 0； 应与产品发行要素里设置的认购、申购、赎回手续费率计算结果一致。数值，最大长度 11 位 单位：元，精度：2
产品单位净值	31LastPx	LastPx	条件选填	净值型产品必填 同一交易日，认购申购赎回确认里的“产品单位净值”需等于产品净值文件里的“产品单位净值” 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
摘要/说明	58 Text	Txt	否	最大长度 60 位
产品账户利息金额	159 AccruedInterestAmt	AcrdIntAmt	否	认购确认时，若认购期产生利息则填写该字段 数值，最大长度 11 位 单位：元，精度：2
产品账户利息金额转份额	11945VolumeByInterest	VolumeByInterest	否	认购确认时，若认购期产生的利息用于转换成投资人的份额则填写该字段，该字段为利息金额，非转换成的份额 若该字段有值，则更新国债系统里认购操作的确认金额时，认购确认金额=交易确认金额+该字段的



				值 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：2
份额强制调整标志	11950MandatoryAdjustment Type	MandatoryAdjustmentType	否	份额强制调增、调减时填写该字段 枚举值： 1 表示管理人批量调整 2 表示管理人普通调整 5 表示产品分拆 9 表示净值调整

### 5.3.3.2 认购申购赎回确认 IMIX 报文标准

认购申购赎回确认IMIX报文标准见表14。

表20 认购申购赎回确认 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>					
8			BeginString	IMIX. 2.0	IMIX 协议版本
9			BodyLength	20	报文体长度
35			MsgType	BN	报文类型 BN-ExecutionAcknowledgement
49			SenderCompID	XXX	报文发送方
56			TargetCompID	XXX	报文接收方
57			TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34			MsgSeqNum	1	报文序列号
52			SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>					
17			ExecID	XXX	成交编号 中国外汇交易中心货币及债务 工具发行系统生成的认购/申购 /赎回申请单编号 业务代码为 130、122、124 时， 该字段必传，且需与认购申购赎 回申请中的成交编号保持一致； 业务代码为其他代码时，该字段 不传。 文本，最大长度 24 位
10795			CnfmTime	20180513-12:30:00	交易确认日期 指认购、申购、赎回确认份额的 日期或份额强制、强减及产品到

					期兑付的日期 格式: YYYYMMDD-HH:SS:MM, 截取前八位
10639			SubmitTime	20180512-12:30:00	交易发生日期、交易发生时间 认购、申购、赎回确认时, 需填写为投资人的申请时间; 份额强制、强减及产品到期兑付时, 需填写为具体发生时间格式: YYYYMMDD-HH:SS:MM
11877			BusinessIdentity	130	业务代码 枚举值: 130 表示认购确认 122 表示申购确认 124 表示赎回确认 144 表示份额强制调增 145 表示份额强制调减 151 表示产品到期兑付
120			SettlCurrency	USD	结算币种 最大长度 3 位 枚举值为: CNY、USD、EUR、JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、CHF、CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、THB
11680			ConfirmedNum	1000	交易确认份数 1) 业务代码为 130 时, 填写包含认购期利息但扣除了手续费后确认的总份额; 2) 业务代码为 122 时, 填写扣除手续费后确认的总份额; 3) 业务代码为 124 时, 填写交易确认份额; 4) 业务代码为 144 或 145 时, 填写调增、调减的交易确认份数; 5) 业务代码为 151 时, 填写到期兑付的总份额。 数值, 最大长度 17 位 单位: 份, 精度: 2
11681			ConfirmedAmt	1000	交易确认金额 1) 业务代码为 130 时, 填写认购扣除手续费后的确认金额, 不

					包含认购期利息； 2) 业务代码为 122 且申请模式为 NAV 时，填写申购扣除手续费后的确认金额 3) 业务代码为 124 且申请模式为 NAV 时，填写扣除赎回手续费的结算金额； 4) 业务代码为 144 和 145 时，填写为 0； 5) 业务代码为 151 时，填写到期兑付的总金额； 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：2
150			ExecType	F	交易处理返回代码 枚举值： F-成功 8-失败 认购、申购、赎回结算失败时，填写为 8-失败，此时交易确认份数和交易确认金额均填写为 0
1328			RejectText	XXX	出错详细信息 文本，最大长度 100 位
10848			TransactionNum	1000	申请份数 赎回时，传输该字段数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
10312			TradeCashAmt	1000	申请金额 现金认购或现金申购时，传输该字段数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：2
11944			CompletedIndicator	Y	业务过程完全结束标识 枚举值： N-否 Y-是 当一笔业务成交进行多次确认时，在未完全结束时，填写 N； 当业务完全结束，填写 Y；
31			LastPx	56.98	产品单位净值 净值型产品必填 同一交易日，认购申购赎回确认里的“产品单位净值”需等于产

					品净值文件里的“产品单位净值” 数值，最大长度 8 位 单位：元，精度：4
58			Text	XXX	摘要/说明 最大长度 60 位
159			AccruedInterestAmt	450	产品账户利息金额 认购确认时，若认购期产生利息 则填写该字段 数值，最大长度 11 位 单位：元，精度：2
11945			VolumeByInterest	1000	产品账户利息金额转份额 认购确认时，若认购期产生的利息 用于转换成投资人的份额则 填写该字段，该字段为利息金 额，非转换成的份额 若该字段有值，则更新货债系统 里认购操作的确认金额时，认购 确认金额=交易确认金额+该字 段的值 数值，最大长度 17 位 单位：元，精度：2
11950			MandatoryAdjustmentType	0	份额强制调整标志 份额强制调增、调减时填写该字 段 枚举值： 1 表示管理人批量调整 2 表示管理人普通调整 5 表示产品分拆 9 表示净值调整
<b>Instrument</b>					
48			SecurityID	XXXX	产品代码 需与中国外汇交易中心货币及 债务工具发行系统里的产品代 码一致 文本，最大长度 32 位
<b>ApplicationSequenceControl</b>					
1181			ApplSeqNum	405968	流水号 文本，填写数字，最大长度 24 位
<b>UndInstrmtGrp</b>					
711			NoUnderlyings	2	重复次数

→	311		UnderlyingSymbol	—	必须域，固定传输“—”
→	309		UnderlyingSecurityID	XXX	申请债券代码 按债券清单认申赎时，传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	879		UnderlyingQty	1000.01	申请债券券面总额 按债券清单认申赎时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	12047		UnderlyingCnfmSecurityID	XXX	交易确认债券代码 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	12026		UnderlyingCnfmQty	1000.01	交易确认债券券面总额 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	12027		UnderlyingCnfmSettlCurrAmt	100000.01	交易确认债券结算金额 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 最大长度 18 位 精度：2，单位：元
→	311		UnderlyingSymbol	—	必须域，固定传输“—”
→	309		UnderlyingSecurityID	XXX	申请债券代码 按债券清单认申赎时，传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	879		UnderlyingQty	1200.01	申请债券券面总额 按债券清单认申赎时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	12047		UnderlyingCnfmSecurityID	XXX	交易确认债券代码 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	12026		UnderlyingCnfmQty	1200.01	交易确认债券券面总额 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 最大长度 17 位

					精度：2，单位：万元
→	12027		UnderlyingCnfmSettlCurrAmt	100000.01	交易确认债券结算金额 按债券清单认购/申购/赎回时， 传输该字段 最大长度 18 位 精度：2，单位：元
<b>CommissionData</b>					
12			Commission	59.69	手续费 认购、申购、赎回确认时发行人 收取的价内手续费(指手续费不 单独收,直接在申请现金金额或 申请债券折算成的现金金额里 扣除),若无价内手续费则填写 为 0; 应与产品发行要素里设置的认 购、申购、赎回手续费率计算结 果一致。 数值,最大长度 11 位 单位:元,精度:2
<b>Parties</b>					
453			NoPartyIDs	1	重复组次数
→	448		PartyID	XXX	机构 21 位码 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	452		PartyRole	1	1-机构
→	802		NoPartySubIDs	1	重复次数
→	→	523	PartySubID	XXXXX	填写机构中文全称的具体值 文本,最大长度 300 位 选填,投资人在中国外汇交易中 心的中文全称
→	→	803	PartySubIDType	124	124-机构中文全称
<b>StandardTrailer</b>					
10			CheckSum	XXX	

### 5.3.3.3 认购申购赎回确认 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<!--
    Description:认购申购赎回确认
    ExecAck 节点对应认购申购赎回确认 IMIX 报文标准中的结构
    ExecAckNum 为实际传输的认购申购赎回确认的数量
-->
<IMIXML>

```

<ExecAckList ExecAckNum="2">

<ExecAck

ExecID="XXX"

CnfmTime="20180513-12:30:00"

SubmitTime="20180512-12:30:00"

BusinessIdentity="130"

SettlCcy="USD"

ConfirmedNum="1000"

ConfirmedAmt="1000"

ExecTyp="F"

RejTxt="XXX"

TransactionNum="1000"

TradeCashAmt="1000"

CompletedIndicator="Y"

LastPx="56.98"

Txt="XXX"

AcrdIntAmt="450"

VolumeByInterest="1000"

MandatoryAdjustmentType="0">

<ApplSeqCtrl ApplSeqNum="XXX"/>

<Instrmt ID="XXX"/>

<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="1000.01" UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"

UnderlyingCnfmQty="1000.01" UnderlyingCnfmSettlCurrAmt="100000.01"/>

<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="1200.01" UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"

UnderlyingCnfmQty="1200.01" UnderlyingCnfmSettlCurrAmt="100000.01"/>

<Comm Comm="59.69"/>

<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">

<Sub NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>

</Pty>

</ExecAck>

<ExecAck

ExecID="XXX"

CnfmTime="20180513-12:30:00"

SubmitTime="20180512-12:30:00"

BusinessIdentity="130"

SettlCcy="USD"

ConfirmedNum="1000"

ConfirmedAmt="1000"

ExecTyp="8"

RejTxt="XXX"

TransactionNum="1000"

TradeCashAmt="1000"

CompletedIndicator="N"

```

LastPx="56.98"
Txt="XXX"
AcrdIntAmt="450"
VolumeByInterest="1000"
MandatoryAdjustmentType="0">
<ApplSeqCtrl ApplSeqNum="XXX"/>
<Instrmt ID="XXX"/>
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="1000.01" UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
UnderlyingCnfmQty="1000.01" UnderlyingCnfmSettlCurrAmt="100000.01"/>
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="1200.01" UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
UnderlyingCnfmQty="1200.01" UnderlyingCnfmSettlCurrAmt="100000.01"/>
<Comm Comm="59.69"/>
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">
    <Sub NoPartySubIDs="1" ID="XXX" Typ="124"/>
</Pty>
</ExecAck>
.....
</ExecAckList>
</IMIXML>

```

### 5.3.4 持有人名册

发行人传输全量更新的持有人名册给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里该持有人的可用产品份数、产品总份数（含冻结）、产品冻结总份数、账户状态等字段。中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统将根据账户状态和持有人可用产品份数控制该持有人的赎回等操作。

持有人名册文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.4.1 持有人名册业务要素

中国外汇交易中心接收持有人名册，具体业务要素请见表15。

表21 持有人名册业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
持有人 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时， 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本 投资人在中国外汇交易中心 的 21 位编码
日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS 截取前八位
产品总份数（含冻结）	11674 TotSecurityNum	TotSecurityNum	是	数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
可用份数	11951 AvaSecurityNum	AvaSecurityNum	是	数值，最大长度 17 位



				单位：份，精度：2
冻结份数	11952 FreezeSecurityNum	FreezeSecurityNum	是	数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
账户状态	使用 Parties 组件 10638 PartyStatus	使用 Pty 组件 PartyStatus	是	枚举值： 0-正常 4-冻结

### 5.3.4.2 持有人名册 IMIX 报文标准

持有人名册IMIX报文标准见表16。

表22 持有人名册 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>				
8		BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	AK	报文类型 AK-Confirmation
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
773		ConfirmType	118	取值 118 标识该报文为持有人名册
11951		AvaSecurityNum	400	可用份数 数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
11674		TotSecurityNum	900	产品总份数（含冻结） 数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
60		TransactTime	20180529-12:30:03	日期 格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS 截取前八位
11952		FreezeSecurityNum	20	冻结份数 数值，最大长度 17 位 单位：份，精度：2
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
<b>Parties</b>				
453		NoPartyIDs	1	重复组次数

→	448	PartyID	XXX	持有人 21 位码 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	452	PartyRole	1	1-机构
→	10638	PartyStatus	0	账户状态 枚举值： 0-正常 4-冻结
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.4.3 持有人名册 XML 消息示例

```

<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<!--
Description:持有人名册
Cnfm 节点对应持有人名册 IMIX 报文标准中的结构，CnfmTyp=118 为固定值，用于标识该消息为持有人名册
CnfmNum 为实际传输的持有人名册的数量
-->
<IMIXML>
  <CnfmList CnfmNum="2">
    <Cnfm
      CnfmTyp="118"
      TxnTm="20180529-12:30:03"
      TotSecurityNum="900"
      AvaSecurityNum="400"
      FreezeSecurityNum="20">
      <Instrmt ID="XXX"/>
      <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1" PartyStatus="0"/>
    </Cnfm>
    <Cnfm
      CnfmTyp="118"
      TxnTm="20180529-12:30:03"
      TotSecurityNum="900"
      AvaSecurityNum="400"
      FreezeSecurityNum="20">
      <Instrmt ID="XXX"/>
      <PtyNoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1" PartyStatus="0"/>
    </Cnfm>
    .....
  </CnfmList>
</IMIXML>

```

### 5.3.5 现金差额和现金替代的退补明细

发行人全量传输最新的现金差额和现金替代的退补明细信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统据此更新确认资金类型、应收款标志、净金额等字段。

现金差额和现金替代的退补明细文件目录结构及命名请见4.4章节。

### 5.3.5.1 现金差额和现金替代的退补明细业务要素

中国外汇交易中心接收现金差额和现金替代的退补明细，具体业务要素请见表17。

表23 现金差额和现金替代的退补明细业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
成交编号	17 ExecID	ExecID	是	文本，最大长度 24 位 认申赎申请的编号
资金类型	707PosAmtType	Typ	是	CSRE-现金差额退补 CAS-现金差额 CRER-现金替代退补 CASH-替代现金 当申购和赎回没有划付现金 差额和替代现金时，传输枚 举值“现金差额”和“替代 现金”
退补结算日期	64SettlDate	SettlDt	是	格式：YYYYMMDD
应收款标志	54Side	Side	是	枚举值： R-发行人应收 P-发行人应付
净金额	708PosAmt	Amt	是	数值，单位：元，最大长度 18 位，精度：2
应收款币种	1055PositionCurrency	Ccy	是	枚举值：CNY、USD、EUR、JPY、 HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、 CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、 KRW、AED、SAR、HUF、PLN、 DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、 THB
替代债券代码	309UnderlyingSecurityID	ID	条件选 填	当资金类型为现金替代退补 或替代现金时，传输该字段 文本，最大长度 100 位
替代债券券面 总额	879UnderlyingQty	Qty	条件选 填	当资金类型为现金替代退补 或替代现金时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
替代债券结算	12028UnderlyingSettlCurrAmt	UnderlyingSettlCurrAmt	条件选	当资金类型为现金替代退补

金额			填	或替代现金时，传输该字段数值，单位：元，精度：2 最大长度 18 位
----	--	--	---	---------------------------------------

### 5.3.5.2 现金差额和现金替代的退补明细 IMIX 报文标准

现金差额和现金替代的退补明细IMIX报文标准见表18。

表24 现金差额和现金替代的退补明细 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>					
8			BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9			BodyLength	20	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型 8-ExecutionReport
49			SenderCompID	XXX	报文发送方
56			TargetCompID	XXX	报文接收方
57			TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34			MsgSeqNum	1	报文序列号
52			SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>					
12029			ExecutionReportType	1	取值 1 表示该报文为现金差额和现金替代的退补明细
64			SettlDate	20191010	退补结算日期 格式：YYYYMMDD
17			ExecID	XXXXXXXXXX	成交编号 文本，最大长度 24 位
54			Side	P	应收款标志 枚举值： R-发行人应收 P-发行人应付
<b>PositionAmountData</b>					
753			NoPosAmt	1	
→	708		PosAmt	233457. 01	净金额 数值，单位：元，最大长度 18 位，精度：2
→	707		PosAmtType	CSRE	资金类型 枚举值： CSRE-现金差额退补 CAS-现金差额 CRER-现金替代退补 CASH-替代现金 当申购和赎回没有划付现金

					差额和替代现金时，传输枚 举值“现金差额”和“替代 现金”
→	1055		PositionCurrency	CNY	应收款币种 枚举值：CNY、USD、EUR、JPY、 HKD、GBP、AUD、NZD、SGD、 CHF、CAD、MYR、RUB、ZAR、 KRW、AED、SAR、HUF、PLN、 DKK、SEK、NOK、TRY、MXN、 THB
<b>Instrument</b>					
48			SecurityID	XXXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
<b>UndInstrmtGrp</b>					
711			NoUnderlyings	2	当资金类型为现金替代退补 时，传输该组件
→	311		UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传“-”
→	309		UnderlyingSecurityID	XXXXX	替代债券代码 文本，最大长度 100 位
→	879		UnderlyingQty	58.01	替代债券券面总额 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	12028		UnderlyingSettlCurrAmt	123000.01	替代债券结算金额 数值，单位：元，最大长度 18 位，精度：2
→	311		UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传“-”
→	309		UnderlyingSecurityID	XXXXX	替代债券代码 文本，最大长度 100 位
→	879		UnderlyingQty	854.01	替代债券券面总额 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	12028		UnderlyingSettlCurrAmt	454000.01	替代债券结算金额 数值，单位：元，最大长度 18 位，精度：2
<b>StandardTrailer</b>					
10			Checksum	XXX	

### 5.3.5.3 现金差额和现金替代的退补明细

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

```
<!--
```

Description:现金差额和现金替代的退补明细

ExecRpt 节点对应现金差额和现金替代的退补明细 IMIX 报文标准中的结构，以 ExecutionReportType=1，标识该消

息为现金差额和现金替代的退补明细

可传输多个现金差额和现金替代的退补明细，ExecRptNum 为实际传输的现金差额和现金替代的退补明细数量

```
-->
<IMIXML>
  <ExecRptList ExecRptNum="2">
    <ExecRpt
      ExecutionReportType="1"
      ExecID="XXXX"
      SettlDt="20191010"
      Side="P">
        <Instrmt ID="XXX"/>
        <Amt NoPosAmt="1" Amt="233457.01" Typ="CSRE" Ccy="CNY"/>
        <Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="58.01" UnderlyingSettlCurrAmt="123000.01"/>
        <Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="854.01" UnderlyingSettlCurrAmt="454000.01"/>
      </ExecRpt>
    <ExecRpt
      ExecutionReportType="1"
      ExecID="XXXX"
      SettlDt="20191010"
      Side="P">
        <Instrmt ID="XXX"/>
        <Amt NoPosAmt="1" Amt="233457.01" Typ="CSRE" Ccy="CNY"/>
        <Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" Qty="58.01" UnderlyingSettlCurrAmt="123000.01"/>
        <Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" Qty="854.01" UnderlyingSettlCurrAmt="454000.01"/>
      </ExecRpt>
    .....
  </ExecRptList>
</IMIXML>
```

### 5.3.6 产品分红

每日日终在固定时间范围内，发行人可传输全量更新的产品分红信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心货币及债务工具发行系统据此更新确认分红类型、现金分红金额、红利再投份额等字段。

产品分红文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.6.1 产品分红业务要素

中国外汇交易中心接收产品分红，具体业务要素请见表19。

表25 产品分红业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
结算日期	64SettlDate	SettlDt	是	格式：YYYYMMDD

持有人 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时, ID 的值	是	文本 投资人在中国外汇交易中心 的 21 位编码
分红类型	12042DividendType	DividendType	是	枚举值: 1-红利再投 2-现金分红
现金分红金额	12030DividendCashAmount	DividendCashAmount	条件选填	单位:元 数值, 最大长度 18 位 精度: 2 分红类型为 2-现金分红时, 传输该字段
红利再投份额	12031DividendReinvestNum	DividendReinvestNum	条件选填	数值, 最大长度 18 位 单位: 份, 精度: 2 红利再投时转化成的产品的 份额 分红类型为 1-红利再投时, 传输该字段

### 5.3.6.2 产品分红 IMIX 报文标准

产品分红IMIX报文标准见表20。

表26 产品分红 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>				
8		BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	f	报文类型 f-SecurityStatus
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
12032		SecurityStatusType	1	1-产品分红信息
64		SettlDate	20190410	结算日期 格式: YYYYMMDD
12042		DividendType	1	分红类型 枚举值: 1-红利再投 2-现金分红
12030		DividendCashAmount	2345678. 01	现金分红金额

				单位:元 数值, 最大长度 18 位 精度: 2 分红类型为 2-现金分红时, 传输该字段
12031		DividendReinvestNum	50.01	红利再投份额 数值, 最大长度 18 位 单位: 份, 精度: 2 红利再投时转化成的产品的份额 分红类型为 1-红利再投时, 传输该字段
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXXX	产品代码 需与货债系统里的产品代码一致 文本, 最大长度 32 位
<b>Parties</b>				
453		NoPartyIDs	1	重复组次数
→	448	PartyID	XXX	持有人 21 位码 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
→	452	PartyRole	1	1-机构
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.6.3 产品分红 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:产品分红

SecStat 节点对应产品分红 IMIX 报文标准中的结构, 以 SecurityStatusType=1, 标识该消息为产品分红

可传输多个产品分红信息, SecStatNum 为实际传输的产品分红数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecStatList SecStatNum="2">
```

```
<SecStat
```

```
SecurityStatusType="1"
```

```
SettlDt="20190410"
```

```
DividendType="1"
```

```
DividendCashAmount="2345678.01"
```

```
DividendReinvestNum="50.01">
```

```
<InstrmtID="XXXX"/>
```



```

        <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
    </SecStat>
    <SecStat
        SecurityStatusType="1"
        SettleDt="20190410"
        DividendType="1"
        DividendCashAmount="2345678.01"
        DividendReinvestNum="50.01">
        <InstrmtID="XXXX"/>
        <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
    </SecStat>
    .....
</SecStatList>
</IMIXML>

```

### 5.3.7 PCF 清单

发行人全量传输最新的PCF清单信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里T-1日现金差额、T-1日最小申购赎回单位净值、T-1日产品单位净值等字段。

PCF清单文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.7.1 PCF 清单业务要素

中国外汇交易中心接收PCF清单，具体业务要素请见表21。

表27 PCF 清单业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
T-1 日日期	使用 Instrument 组件 10085LastTradeDate	使用 Instrmt 组件 LastTradeDate	是	日期，格式： YYYYMMDD
T-1 日最小申购单位的现金差额	10084LastTradeCashSpread	LastTradeCashSpread	条件必填	申购债券代码填写时必填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
T-1 日最小赎回单位的现金差额	12043LastMinUnitRedempCashSpread	LastMinUnitRedempCashSpread	条件必填	赎回债券代码填写时必填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
T-1 日最小申	使用 Instrument 组件 10083LastSubRedempMinUnit	使用 Instrmt 组件 LastSubRedempMinUnit	是	数值，最大长度 17 位

购、赎回单位净值				精度：2，单位：元
T-1 日产品单位净值	使用 Instrument 组件 10079LastIOPValue	使用 Instrmt 组件 LastIOPValue	是	数值，最大长度 17 位 精度 2，单位：元
T 日日期	75TradeDate	TrdDt	是	日期，格式： YYYYMMDD
T 日最小申购单位的预估现金部分	使用 Instrument 组件 10313TradeEstimatedCashAmt	使用 Instrmt 组件 TradeEstimatedCashAmt	条件必填	申购债券代码填写时必填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
T 日最小赎回单位的预估现金部分	使用 Instrument 组件 12033TradeRedempEstimatedCashAmt	使用 Instrmt 组件 TradeRedempEstimatedCashAmt	条件必填	赎回债券代码填写时必填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
T 日现金替代比例上限	使用 Instrument 组件 10016CashSubPropCap	使用 Instrmt 组件 CashSubPropCap	是	数值，0-100 之间， 精度：2，单位：%
T 日单家机构申购上限	使用 Instrument 组件 12034InstitutionMaxPrchsAmount	使用 Instrmt 组件 InstitutionMaxPrchsAmount	否	数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份
T 日单家机构赎回上限	使用 Instrument 组件 12035InstitutionMaxRedempAmount	使用 Instrmt 组件 InstitutionMaxRedempAmount	否	数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份
T 日全市场申购上限	使用 Instrument 组件 12036MarketMaxPrchsAmount	使用 Instrmt 组件 MarketMaxPrchsAmount	否	数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份 针对全市场
T 日全市场赎回上限	使用 Instrument 组件 12037MarketMaxRedempAmount	使用 Instrmt 组件 MarketMaxRedempAmount	否	数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份 针对全市场
T 日最小申购赎回单位	使用 Instrument 组件 10306SubRedempMinUnit	使用 Instrmt 组件 SubRedempMinUnit	是	数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份

申购债券代码	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=0 表示申购 309UnderlyingSecurityID 表示申购 债券代码	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=0 表示申 购 ID 表示申购债券代码	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止赎回”时， 传输该字段 文本，最大长度：100 位
申购债券券面 总额	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=0 表示申 购 879UnderlyingQty 表示申购债券券 面总额	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=0 表示申 购 Qty 表示申购债券券面总额	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止赎回”时， 传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万 元
申购债券参考 全价	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=0 表示申 购 882UnderlyingDirtyPrice 表示申购 债券参考全价	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=0 表示申 购 DirtPx 表示申购债券参考全价	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止赎回”时， 传输该字段 数值，最大长度 18 位 精度：4，单位：元
申购债券现金 替代标志	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=0 表示申 购 12038UnderlyingCashSubType 表示 申购债券现金替代标志	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=0 表示申 购 UnderlyingCashSubType 表示申 购债券现金替代标志	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止赎回”时， 传输该字段 枚举值： 1-必须 2-允许 3-禁止
申购债券现金 替代溢价比例	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=0 表示申 购 10324UnderlyingCashSubPremRatio 表示申购债券现金替代溢价比例	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=0 表示申 购 UnderlyingCashSubPremRatio 表示申购债券现金替代溢价比 例	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止赎回”时， 传输该字段 数值，0-100 之间， 精度：2，单位：%
赎回债券代码	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=1 表示赎 回 309UnderlyingSecurityID 表示赎回 债券代码	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=1 表示赎 回 ID 表示赎回债券代码	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止申购”时， 传输该字段 文本，最大长度 100 位
赎回债券券面 总额	使用 UnderlyingInstrument 组件， 10305 SubRedempIndicator=1 表示赎 回 879UnderlyingQty 表示赎回债券券 面总额	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=1 表示赎 回 Qty 表示赎回债券券面总额	条件选填	产品状态为“可申购 赎回、停止申购”时， 传输该字段 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位： 万元

赎回债券参考全价	使用 UnderlyingInstrument 组件, 10305 SubRedempIndicator=1 表示赎回 882UnderlyingDirtyPrice 表示赎回债券参考全价	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=1 表示赎回 DirtPx 表示赎回债券参考全价	条件选填	产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 数值, 最大长度 18 位, 精度: 4, 单位: 元
赎回债券现金替代标志	使用 UnderlyingInstrument 组件, 10305 SubRedempIndicator=1 表示赎回 12038UnderlyingCashSubType 表示赎回债券现金替代标志	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=1 表示赎回 UnderlyingCashSubType 表示赎回债券现金替代标志	条件选填	产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 枚举值: 1-必须 2-允许 3-禁止
赎回债券现金替代溢价比例	使用 UnderlyingInstrument 组件, 10305 SubRedempIndicator=1 表示赎回 10324UnderlyingCashSubPremRatio 表示赎回债券现金替代溢价比例	使用 Undly 组件 SubRedempIndicator=1 表示赎回 UnderlyingCashSubPremRatio 表示赎回债券现金替代溢价比例	条件选填	产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 数值, 0-100 之间, 精度: 2, 单位: %

### 5.3.7.2 PCF 清单 IMIX 报文标准

PCF清单IMIX报文标准见表22。

表28 PCF 清单 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>				
8		BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	d	报文类型 d-SecurityDefinition
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
11272		SecurityDefinitionType	19	19-PCF 清单
10084		LastTradeCashSpread	45612.36	T-1 日最小申购单位的现金差额 申购债券代码填写时必须填 数值, 最大长度 17 位 精度 2, 单位: 元
12043		LastMinUnitRedempCashS	45612.26	T-1 日最小赎回单位的现金差额

		pread		赎回债券代码填写时必须填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
75		TradeDate	20180222	T 日日期 格式：YYYYMMDD
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
10085		LastTradeDate	20180121	T-1 日日期 格式：YYYYMMDD
10083		LastSubRedempMinUnit	5641234.26	T-1 日最小申购、赎回单位净值 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
10079		LastIOPValue	2.32	T-1 日产品单位净值 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
10313		TradeEstimatedCashAmt	12540.25	T 日最小申购单位的预估现金部分 申购债券代码填写时必须填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
12033		TradeRedempEstimatedCashAmt	12540.15	T 日最小赎回单位的预估现金部分 赎回债券代码填写时必须填 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：元
10016		CashSubPropCap	20.02	T 日现金替代比例上限 数值，0-100 之间 精度：2，单位：%
10306		SubRedempMinUnit	1000.21	T 日最小申购赎回单位 数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份
12034		InstitutionMaxPrchsAmount	200.09	T 日单家机构申购上限 数值，最大长度 18 位 精度：2，单位：份
12035		InstitutionMaxRedempAmount	180.07	T 日单家机构赎回上限 数值，最大长度 18 位 精度：2 单位：份
12036		MarketMaxPrchsAmount	240.09	T 日全市场申购上限 数值，最大长度 18 位 精度：2

				单位：份 针对全市场
12037		MarketMaxRedempAmount	300.04	T 日全市场赎回上限 数值，最大长度 18 位 精度：2 单位：份 针对全市场
<b>UndInstrmtGrp</b>				
711		NoUnderlyings	4	
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输“-”
→	10305	SubRedempIndicator	0	0-申购
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	申购债券代码 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	879	UnderlyingQty	2000.03	申购债券券面总额 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	882	UnderlyingDirtyPrice	108.0634	申购债券参考全价 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 精度：4，单位：元
→	12038	UnderlyingCashSubType	2	申购债券现金替代标志 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 枚举值： 1-必须 2-允许 3-禁止
→	10324	UnderlyingCashSubPremRatio	21.02	申购债券现金替代溢价比例 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 数值，0-100 之间 精度：2，单位：%
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输“-”
→	10305	SubRedempIndicator	1	1-赎回
→	309	UnderlyingSecurityID	XXXXX	赎回债券代码 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时，传输该字段

				文本，最大长度 100 位
→	879	UnderlyingQty	2000.04	赎回债券券面总额 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	882	UnderlyingDirtyPrice	108.0234	赎回债券参考全价 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 精度：4，单位：元
→	12038	UnderlyingCashSubType	1	赎回债券现金替代标志 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时，传输该字段 枚举值： 1-必须 2-允许 3-禁止
→	10324	UnderlyingCashSubPremRatio	23.02	赎回债券现金替代溢价比例 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时，传输该字段 数值，0-100 之间 精度：2，单位：%
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输“-”
→	10305	SubRedempIndicator	0	0-申购
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	申购债券代码 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 文本，最大长度 100 位
→	879	UnderlyingQty	2000.04	申购债券券面总额 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 数值，最大长度 17 位 精度：2，单位：万元
→	882	UnderlyingDirtyPrice	108.0634	申购债券参考全价 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段 数值，最大长度 18 位 精度：4，单位：元
→	12038	UnderlyingCashSubType	2	申购债券现金替代标志 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时，传输该字段

				枚举值: 1-必须 2-允许 3-禁止
→	10324	UnderlyingCashSubPremRatio	21.02	申购债券现金替代溢价比例 产品状态为“可申购赎回、停止赎回”时, 传输该字段 数值, 0-100 之间 精度: 2, 单位: %
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域, 固定传输“-”
→	10305	SubRedempIndicator	1	1-赎回
→	309	UnderlyingSecurityID	XXXXX	赎回债券代码 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 文本, 最大长度 100 位
→	879	UnderlyingQty	2000.04	赎回债券券面总额 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 数值, 最大长度 17 位 精度: 2, 单位: 万元
→	882	UnderlyingDirtyPrice	108.0234	赎回债券参考全价 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 数值, 最大长度 18 位 精度: 4, 单位: 元
→	12038	UnderlyingCashSubType	1	赎回债券现金替代标志 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 枚举值: 1-必须 2-允许 3-禁止
→	10324	UnderlyingCashSubPremRatio	23.02	赎回债券现金替代溢价比例 产品状态为“可申购赎回、停止申购”时, 传输该字段 数值, 0-100 之间 精度: 2, 单位: %
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

## 5.3.7.3 PCF 清单 XML 消息示例

&lt;?xml version="1.0" encoding="utf-8"?&gt;



&lt;!--

Description:PCF 清单

SecDef 节点对应 PCF 清单信息 IMIX 报文标准中的结构，以 SecurityDefinitionType=19，标识该消息为 PCF 清单信息

可传输多个 PCF 清单信息，SecDefListNum 为实际传输的 PCF 清单信息的数量

--&gt;

&lt;IMIXML&gt;

&lt;SecDefList SecDefListNum="2"&gt;

&lt;SecDef

SecurityDefinitionType="19"

LastTradeCashSpread="45612.36"

LastMinUnitRedempCashSpread="45612.26"

TrdDt="20180222"&gt;

&lt;Instrmt

ID="XXX"

LastTradeDate="20180121"

LastSubRedempMinUnit="5641234.26"

LastIOPValue="2.32"

TradeEstimatedCashAmt="12540.25"

TradeRedempEstimatedCashAmt="12540.15"

CashSubPropCap="20.02"

InstitutionMaxPrchsAmount="200.09"

InstitutionMaxRedempAmount="180.07"

MarketMaxPrchsAmount="240.09"

MarketMaxRedempAmount="300.04"

SubRedempMinUnit="1000.21"/&gt;

<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" SubRedempIndicator="0" ID="XXXX" Qty="2000.03"  
DirtPx="108.0634" UnderlyingCashSubType="2" UnderlyingCashSubPremRatio="21.02"/>

<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" SubRedempIndicator="1" ID="XXXX" Qty="2000.04"  
DirtPx="108.0234" UnderlyingCashSubType="1" UnderlyingCashSubPremRatio="23.02"/>

<Undly NoUnderlyings="3" Sym="-" SubRedempIndicator="0" ID="XXXX" Qty="2000.04"  
DirtPx="108.0634" UnderlyingCashSubType="2" UnderlyingCashSubPremRatio="21.02"/>

<Undly NoUnderlyings="4" Sym="-" SubRedempIndicator="1" ID="XXXX" Qty="2000.04"  
DirtPx="108.0234" UnderlyingCashSubType="1" UnderlyingCashSubPremRatio="23.02"/>

&lt;/SecDef&gt;

&lt;SecDef

SecurityDefinitionType="19"

LastTradeCashSpread="45612.36"

LastMinUnitRedempCashSpread="45612.26"

TrdDt="20180222"&gt;

&lt;Instrmt

ID="XXX"

LastTradeDate="20180121"

```

LastSubRedempMinUnit="5641234.26"
LastIOPValue="2.32"
TradeEstimatedCashAmt="12540.25"
TradeRedempEstimatedCashAmt="12540.15"
CashSubPropCap="20.02"
InstitutionMaxPrchsAmount="200.09"
InstitutionMaxRedempAmount="180.07"
MarketMaxPrchsAmount="240.09"
MarketMaxRedempAmount="300.04"
SubRedempMinUnit="1000.21"/>
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" SubRedempIndicator="0" ID="XXXX" Qty="2000.03"
DirtPx="108.0634" UnderlyingCashSubType="2" UnderlyingCashSubPremRatio="21.02"/>
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" SubRedempIndicator="1" ID="XXXX" Qty="2000.04"
DirtPx="108.0234" UnderlyingCashSubType="1" UnderlyingCashSubPremRatio="23.02"/>
<Undly NoUnderlyings="3" Sym="-" SubRedempIndicator="0" ID="XXXX" Qty="2000.04"
DirtPx="108.0634" UnderlyingCashSubType="2" UnderlyingCashSubPremRatio="21.02"/>
<Undly NoUnderlyings="4" Sym="-" SubRedempIndicator="1" ID="XXXX" Qty="2000.04"
DirtPx="108.0234" UnderlyingCashSubType="1" UnderlyingCashSubPremRatio="23.02"/>
</SecDef>

.....
</SecDefList>
</IMIXML>

```

### 5.3.8 产品状态

发行人全量传输最新的产品状态信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里产品状态等字段。

产品状态文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.8.1 产品状态业务要素

中国外汇交易中心接收产品状态，具体业务要素请见表23。

表29 产品状态业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
产品状态	326SecurityTradingStatus	TrdgStat	是	枚举值： 100-可申购赎回 101-发行 102-停止申购赎回 103-停止申购 104-停止赎回 105-产品终止

				106-产品封闭
--	--	--	--	----------

### 5.3.8.2 产品状态 IMIX 报文标准

外汇交易中心接收产品状态，具体IMIX报文标准见表24。

表30 产品状态 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>				
8		BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	f	报文类型 f-SecurityStatus
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
12032		SecurityStatusType	2	2-产品状态
326		SecurityTradingStatus	100	产品状态 枚举值： 100-可申购赎回 101-发行 102-停止申购赎回 103-停止申购 104-停止赎回 105-产品终止 106-产品封闭
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.8.3 产品状态 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:产品状态

SecStat 节点对应产品状态信息 IMIX 报文标准中的结构，以 SecurityStatusType=2，标识该消息为产品状态信息  
可传输多个产品状态的信息，SecStatNum 为实际传输的产品状态信息的数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```

<SecStatList SecStatNum="2">
  <SecStat
    SecurityStatusType="2"
    TrdgStat="100">
    <InstrmtID="XXX"/>
  </SecStat>
  <SecStat
    SecurityStatusType="2"
    TrdgStat="100">
    <InstrmtID="XXX"/>
  </SecStat>
  .....
</SecStatList>
</IMIXML>

```

### 5.3.9 赎回债券清单

发行人全量传输最新的赎回债券清单信息给中国外汇交易中心，中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里赎回最低券面总额、赎回最高券面总额、赎回券面总额变动单位等字段。

赎回债券清单文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.9.1 赎回债券清单业务要素

赎回债券清单业务要素见表25。

表31 赎回债券清单业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
债券代码	309UnderlyingSecurityID	ID	是	文本，最大长度 100 位
赎回最低 券面总额	12039UnderlyingLowestFaceValue	UnderlyingLowestFaceValue	是	数值，最大长度 17 位，精度：2， 单位：万元
赎回最高 券面总额	12040UnderlyingHighestFaceValue	UnderlyingHighestFaceValue	是	数值，最大长度 17 位，精度：2 单位：万元
赎回券面 总额变动 单位	12041UnderlyingFaceValueChangeUnit	UnderlyingFaceValueChangeUnit	是	数值，最大长度 17 位，精度：2 单位：万元

#### 5.3.9.2 赎回债券清单 IMIX 报文标准

赎回债券清单IMIX报文标准见表26。

表32 赎回债券清单 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>				
8		BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	d	报文类型 d-SecurityDefinit ion
49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
11272		SecurityDefinitionType	18	18-赎回债券清单
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
<b>UndInstrmtGrp</b>				
711		NoUnderlyings	2	
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输 “_”
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	债券代码 文本，最大长度 100 位
→	12039	UnderlyingLowestFaceVa lue	1000. 12	赎回最低券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位： 万元
→	12040	UnderlyingHighestFaceV alue	1200. 25	赎回最高券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位： 万元
→	12041	UnderlyingFaceValueCha ngeUnit	5. 01	赎回券面总额变动 单位 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位： 万元
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输 “_”

→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	债券代码 文本，最大长度 100 位
→	12039	UnderlyingLowestFaceValue	1000.13	赎回最低券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：万元
→	12040	UnderlyingHighestFaceValue	1200.46	赎回最高券面总额 数值，最大长度 17 位，精度 2，单位：万元
→	12041	UnderlyingFaceValueChangeUnit	6.01	赎回券面总额变动单位 数值，最大长度 17 位，精度 2，单位：万元
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	XXX	

### 5.3.9.3 赎回债券清单 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:赎回债券清单

SecDef 节点对应赎回债券清单 IMIX 报文标准中的结构，SecurityDefinitionType=18 用于标识该消息为赎回债券清单信息

可传输多个赎回债券清单的信息，SecDefNum 为实际传输的赎回债券清单的数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecDefList SecDefNum="2">
```

```
<SecDef
```

```
SecurityDefinitionType="18">
```

```
<Instrmt ID="XXX"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" UnderlyingLowestFaceValue="1000.12"
UnderlyingHighestFaceValue="1200.25" UnderlyingFaceValueChangeUnit="5.01"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" UnderlyingLowestFaceValue="1000.13"
UnderlyingHighestFaceValue="1200.46" UnderlyingFaceValueChangeUnit="6.01"/>
```

```
</SecDef>
```

```
<SecDef
```

```
SecurityDefinitionType="18">
```

```
<Instrmt ID="XXX"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="1" Sym="-" ID="XXX" UnderlyingLowestFaceValue="1000.12"
UnderlyingHighestFaceValue="1200.25" UnderlyingFaceValueChangeUnit="5.01"/>
```

```
<Undly NoUnderlyings="2" Sym="-" ID="XXX" UnderlyingLowestFaceValue="1000.13"
```

```

    UnderlyingHighestFaceValue="1200.46" UnderlyingFaceValueChangeUnit="6.01"/>
  </SecDef>
  .....
</SecDefList>
</IMIXML>

```

### 5.3.10 申购债券清单

发行人全量传输最新的申购债券清单信息给中国外汇交易中心,中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里申购最低券面总额、申购最高券面总额、申购券面总额变动单位等字段。

申购债券清单文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.10.1 申购债券清单业务要素

申购债券清单业务要素见表27。

表33 申购债券清单业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本, 最大长度 32 位
债券代码	309UnderlyingSecurityID	ID	是	文本, 最大长度 100 位
申购最低 券面总额	12039UnderlyingLowestFaceValue	UnderlyingLowestFaceValue	是	数值, 最大长度 17 位, 精度: 2 单位: 万元
申购最高 券面总额	12040UnderlyingHighestFaceValue	UnderlyingHighestFaceValue	是	数值, 最大长度 17 位, 精度: 2 单位: 万元
申购券面 总额变动 单位	12041UnderlyingFaceValueChangeUnit	UnderlyingFaceValueChangeUnit	是	数值, 最大长度 17 位, 精度: 2 单位: 万元

#### 5.3.10.2 申购债券清单 IMIX 报文标准

申购债券清单IMIX报文标准见表28。

表34 申购债券清单 IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9		BodyLength	20	报文体长度
35		MsgType	d	报文类型 d-SecurityDefinit ion

49		SenderCompID	XXX	报文发送方
56		TargetCompID	XXX	报文接收方
57		TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34		MsgSeqNum	1	报文序列号
52		SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>				
11272		SecurityDefinitionType	3	3-申购债券清单
<b>Instrument</b>				
48		SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
<b>UndInstrmtGrp</b>				
711		NoUnderlyings	2	
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输“_”
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	债券代码 文本，最大长度 100 位
→	12039	UnderlyingLowestFaceValue	1000.12	申购最低券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：万元
→	12040	UnderlyingHighestFaceValue	1200.25	申购最高券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：万元
→	12041	UnderlyingFaceValueChangeUnit	5.01	申购券面总额变动单位 数值，最大长度 17 位，精度：2
→	311	UnderlyingSymbol	-	必须域，固定传输“_”
→	309	UnderlyingSecurityID	XXX	债券代码 文本，最大长度 100 位
→	12039	UnderlyingLowestFaceValue	1000.13	申购最低券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：万元
→	12040	UnderlyingHighestFaceValue	1200.46	申购最高券面总额 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：



				万元
→	12041	UnderlyingFaceValueChangeUnit	6.01	申购券面总额变动单位 数值，最大长度 17 位，精度：2，单位：万元
StandardTrailer				
10		Checksum	XXX	

5.3.10.3 申购债券清单 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<!--
    Description:申购债券清单
    SecDef 节点对应申购债券清单 IMIX 报文标准中的结构，SecurityDefinitionType=3 用于标识该消息为申购债券清单信息
    可传输多个申购债券清单的信息，SecDefNum 为实际传输的申购债券清单的数量
-->
<IMIXML>
  <SecDefList SecDefNum="2">
    <SecDef
      SecurityDefinitionType="3">
        <Instrmt ID="XXX"/>
        <Undly    NoUnderlyings="1"    Sym="-"    ID="XXX"    UnderlyingLowestFaceValue="1000.12"
          UnderlyingHighestFaceValue="1200.25" UnderlyingFaceValueChangeUnit="5.01"/>
        <Undly    NoUnderlyings="2"    Sym="-"    ID="XXX"    UnderlyingLowestFaceValue="1000.13"
          UnderlyingHighestFaceValue="1200.46" UnderlyingFaceValueChangeUnit="6.01"/>
      </SecDef>
    <SecDef
      SecurityDefinitionType="3">
        <Instrmt ID="XXX"/>
        <Undly    NoUnderlyings="1"    Sym="-"    ID="XXX"    UnderlyingLowestFaceValue="1000.12"
          UnderlyingHighestFaceValue="1200.25" UnderlyingFaceValueChangeUnit="5.01"/>
        <Undly    NoUnderlyings="2"    Sym="-"    ID="XXX"    UnderlyingLowestFaceValue="1000.13"
          UnderlyingHighestFaceValue="1200.46" UnderlyingFaceValueChangeUnit="6.01"/>
      </SecDef>
    .....
  </SecDefList>
</IMIXML>
```

5.3.11 开户结果

投资人上传新开户材料给发行人或投资人填写已开户待匹配信息给发行人,发行人据此为投资人开户或据此进行匹配确认,并将开户结果或匹配确认结果批量传输给中国外汇交易中心,中国外汇交易中心据此更新货币及债务工具发行系统里投资人的开户结果信息。

开户结果文件目录结构及命名请见4.4章节。

### 5.3.11.1 开户结果业务要素

中国外汇交易中心接收开户结果信息,开户结果业务要素见表29。

表35 开户结果业务要素

要素名称	IMIX 域	XML 名称	是否必填	说明
开户类型	使用 PartyDetailGrp 组件 12024AccountOpenType	AccountOpenType	是	枚举值: 2-新开户 1-已开户
开户结果	使用 PartyDetailGrp 组件 10604PartyInfoStatus	PartyInfoStatus	是	枚举值: 0-成功 1-失败
投资人机构 21 位码	使用 PartyDetailGrp 组件 1693 PartyDetailRole 取值 1 时 1691PartyDetailID 的值	使用 PtyDetl 组件 R 取值 1 时 ID 的值	条件选填	文本, 最大长度 21 位 投资人机构中文全称未填写时, 传输该字段 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码
投资人机构中文全称	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 124 时表示机构中文全称 1695PartyDetailSubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 124 时表示机构中文全称 ID 填写具体的值	条件选填	文本, 最大长度 300 位 投资人机构 21 位码未填写时, 传输该字段
基金账号	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 280 时表示基金账号 1695 PartyDetailSubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 280 时表示基金账号 ID 填写具体的值	条件选填	文本, 最大长度 100 位 开户结果为成功时, 传输该字段, 且当开户类型为已开户时, 该基金账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中基金账号保持一致
交易账号	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 15 时表示交易账号 1695 PartyDetailSubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 15 时表示交易账号 ID 填写具体的值	条件选填	文本, 最大长度 100 位 开户结果为成功时, 传输该字段, 且当开户类型为已开户时, 该交易账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中交易账号保持一致

	写具体的值			
投资人代码	使用 PartyDetailSubGrp 组件 当 1696PartyDetailSubIDType 取值 232 时表示投资人代码 1695 PartyDetailSubID 填写具体的值	使用 Sub 组件 当 Typ 取值 232 时表示投资人代码 ID 填写具体的值	条件选填	文本，最大长度 100 位 开户结果为成功时，传输该字段，且当开户类型为已开户时，该投资人代码需与交易中心发送的已开户待匹配信息中投资人代码保持一致 统一社会信用代码等

### 5.3.11.2 开户结果 IMIX 报文标准

开户结果IMIX报文标准见表30。

表36 开户结果 IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>					
8			BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9			BodyLength	20	报文体长度
35			MsgType	CG	报文类型 CG-PartyDetailsListReport
49			SenderCompID	XXX	报文发送方
56			TargetCompID	XXX	报文接收方
57			TargetSubID	XXXX	报文接收方子标志
34			MsgSeqNum	1	报文序列号
52			SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>					
10229			PartyInfoType	b	b-开户结果
<b>PartyDetailGrp</b>					
1671			NoPartyDetails	2	
→	1691		PartyDetailID	XXXX	投资人机构 21 位码 文本，最大长度 21 位 投资人机构中文全称未填写时传输该字段， 投资人在中国外汇交易中心的 21 位编码 因该域是必须域，当投资人机

					构 21 位码不传输时，此域固定传“—”
→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构
→	12024		AccountOpenType	2	开户类型 枚举值： 2-新开户 1-已开户
→	10604		PartyInfoStatus	0	开户结果 枚举值： 0-成功 1-失败
→	<b>PartyDetailSubGrp</b>				
→	1694		NoPartyDetailSubIDs	4	
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXX	因该域是必须域，当投资人机构中文全称不传输时，此域固定传“—”
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	124	投资人机构中文全称 文本，最大长度 300 位 投资人机构 21 位码未填写时传输该字段
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	280	280-基金账号 开户结果为成功时，传输该字段，且当开户类型为已开户时，该基金账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中基金账号保持一致 文本，最大长度 100 位
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	15	15-交易账号

			ype		开户结果为成功时,传输该字段,且当开户类型为已开户时,该交易账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中交易账号保持一致 文本,最大长度100位
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubID ype	232	232-投资人代码 开户结果为成功时,传输该字段,且当开户类型为已开户时,该投资人代码需与交易中心发送的已开户待匹配信息中投资人代码保持一致 文本,最大长度100位 统一社会信用代码等
→	1691		PartyDetailID	XXXX	投资人机构 21 位码 文本,最大长度21位 投资人机构中文全称未填写时传输该字段, 投资人在中国外汇交易中心的21位编码 因该域是必须域,当投资人机构 21 位码不传输时,此域固定传“-”
→	1693		PartyDetailRole	1	1-机构

→	12024		AccountOpenType	1	开户类型 枚举值： 2-新开户 1-已开户
→	10604		PartyInfoStatus	0	开户结果 枚举值： 0-成功 1-失败
→	<b>PartyDetailSubGrp</b>				
→	1694		NoPartyDetailSubIDs	4	
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXX	因该域是必须域，当投资人机构中文全称不传输时，此域固定传“—”
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	124	投资人机构中文全称 文本，最大长度300位 投资人机构21位码未填写时传输该字段
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	280	280-基金账号 开户结果为成功时，传输该字段，且当开户类型为已开户时，该基金账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中基金账号保持一致 文本，最大长度100位
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	15	15-交易账号 开户结果为成功时，传输该字段，且当开户类型为已开户时，该交

					易账号需与交易中心发送的已开户待匹配信息中交易账号保持一致 文本，最大长度100 位
→	→	1695	PartyDetailSubID	XXXXXX	
→	→	1696	PartyDetailSubIDType	232	232-投资人代码 开户结果为成功时，传输该字段，且当开户类型为已开户时，该投资人代码需与交易中心发送的已开户待匹配信息中投资人代码保持一致 文本，最大长度100 位 统一社会信用代码等
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

5.3.11.3 开户结果 XML 消息示例

```
<?xml version="1.0" encoding="utf-8"?>
<!--
Description:开户结果
PtyDetlListRpt 节点对应开户结果 IMIX 报文标准中的结构，以 PartyInfoType=b，标识该消息为开户结果信息
由于 PtyDetlListRpt 本身可支持传输多个开户结果，故 PtyDetlListRpt 为最外层节点，若传输多个开户结果，以 PtyDetl
节点，传输多个
-->
<IMIXML>
  <PtyDetlListRpt
    PartyInfoType="b">
      <PtyDetl NoPartyDetails="1"ID="XXX"R="1"AccountOpenType="2"PartyInfoStatus="0">
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="1"ID="XXX"Typ="124"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="2"ID="XXX"Typ="280"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="3"ID="XXX"Typ="15"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="4"ID="XXX"Typ="232"/>
      </PtyDetl>
      <PtyDetl NoPartyDetails="2"ID="XXX"R="1"AccountOpenType="1"PartyInfoStatus="0">
```

```

        <Sub NoPartyDetailSubIDs="1"ID="XXX"Typ="124"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="2"ID="XXX"Typ="280"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="3"ID="XXX"Typ="15"/>
        <Sub NoPartyDetailSubIDs="4"ID="XXX"Typ="232"/>
    </PtyDetl>
    ....
</PtyDetlListRpt>
</IMIXML>

```

### 5.3.12 认购处理结果确认

发行人对认购处理结果确认后，批量将认购处理结果确认信息传输给中国外汇交易中心。  
认购处理结果确认文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.12.1 认购处理结果确认业务要素

认购处理结果确认业务要素见表XXX。

表37 认购处理结果确认业务要素

字段	IMIX 对应	XML 名称	是否必填	说明
产品代码	48 SecurityID	ID	是	文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码
生成日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
投资人 A 21 位机构代码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时， 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本，填写投资人 A 在中国外汇交易中心的 21 位编码
投资人 A 确认债券代码	使用 UndInstrmtGrp 组件 12047UnderlyingCnfmSecurityID	使用 Undly 组件 UnderlyingCnfmSecurityID	是	文本，最大长度 100 位
投资人 A 确认债券券面总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 12026UnderlyingCnfmQty	使用 Undly 组件 UnderlyingCnfmQty	是	数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
投资人 A 确认现金金额	11681ConfirmedAmt	ConfirmedAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
投资人 A 退还现金金额	XXXRefundAmt	RefundAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
投资人 B 21 位机构代码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时， 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时，ID 的值	是	文本，填写投资人 A 在中国外汇交易中心的 21 位编码
投资人 B 确	使用 UndInstrmtGrp 组	使用 Undly 组件	是	文本，最大长度 100 位



认债券代码	件 12047UnderlyingCnfmSecurityID	UnderlyingCnfmSecurityID		
投资人 B 确认债券券面总额	使用 UndInstrmtGrp 组件 12026UnderlyingCnfmQty	使用 Undly 组件 UnderlyingCnfmQty	是	数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
投资人 B 确认现金金额	11681ConfirmedAmt	ConfirmedAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
投资人 B 退还现金金额	12095RefundAmt	RefundAmt	是	数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
.....				
备注	58Text	Txt	是	文本，最大长度 500 位

### 5.3.12.2 认购处理结果确认 IMIX 报文标准

认购处理结果确认IMIX报文标准见表XXX。

表38 认购处理结果确认 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>						
8				BeginString	IMIX.2.0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	U69	报文类型 U69-SecurityListAck
34				MsgSeqNum	1	报文序列号
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
50				SenderSubID	XXX	报文发送方子标识
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
52				SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>						
11202				SecDataType	10	10-认购处理结果确认信息
60				TransactTime	20180101-12:12:12	生成日期 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
58				Text	XXXX	备注 文本，最大长度 500 位
<b>SecListAckGrp</b>						
146				NoRelatedSym	2	
→	48			SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码，

							由于报文结构原因，一条报文会重复传输相同产品代码值
→	11681				ConfirmedAmt	14520.13	投资人 A 确认现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	12095				RefundAmt	15420.12	投资人 A 退还现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	投资人 A 21 位机构代码 文本，填写投资人 A 在中国外 汇交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	12047			UnderlyingCnfmSec urityID	XXX	投资人 A 确认债券代码 1
→	→	12026			UnderlyingCnfmQty	121212.15	投资人 A 确认债券券面总 额 1 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	12047			UnderlyingCnfmSec urityID	XXX	投资人 A 确认债券代码 2
→	→	12026			UnderlyingCnfmQty	121212.15	投资人 A 确认债券券面总 额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	48				SecurityID	XXX	产品代码 文本，最大长度 32 位 一个报文传输一个产品代码， 由于报文结构原因，一条报文 会重复传输相同产品代码值
→	11681				ConfirmedAmt	14520.13	投资人 B 确认现金金额 数值，单位：元 最大长度 18 位，精度 2
→	12095				RefundAmt	15420.12	投资人 B 退还现金金额 数值，单位：元

							最大长度 18 位，精度 2
→	<b>Parties</b>						
→	453				NoPartyIDs	1	
→	→	448			PartyID	XXX	投资人 B 21 位机构代码 文本，填写投资人 A 在中国外 汇交易中心的 21 位编码
→	→	452			PartyRole	1	1-机构
→	<b>UndInstrmtGrp</b>						
→	711				NoUnderlyings	2	
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	12047			UnderlyingCnfmSec urityID	XXX	投资人 B 确认债券代码 1
→	→	12026			UnderlyingCnfmQty	121212.15	投资人 B 确认债券券面总 额 1 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
→	→	311			UnderlyingSymbol	-	必须域，此处固定传“-” 无实际业务含义
→	→	12047			UnderlyingCnfmSec urityID	XXX	投资人 B 确认债券代码 2
→	→	12026			UnderlyingCnfmQty	121212.15	投资人 B 确认债券券面总 额 2 数值，单位：万元 最大长度 17 位，精度 2
<b>StandardTrailer</b>							
10					Checksum	XXX	检验和

### 5.3.12.3 认购处理结果确认 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:认购处理结果确认

SecurityListAck 节点对应认购处理结果确认 IMIX 报文标准中的结构，以 SecDataType=10，标识该消息为认购处理结果确认信息

由于 SecurityListAck 本身可支持传输多个投资人的认购处理结果确认信息，故 SecurityListAck 为最外层节点，若传输多个投资人的认购处理结果确认信息，以 SecListAckGrp 节点，传输多个

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SecList
```

```
  SecDataType="10"
```

```
  TxnTm="20180101-12:12:12"
```

```
  Txt="XXX">
```

```

<SecListAckGrp NoRelatedSym="1" ID="XXX" ConfirmedAmt="14520.13" RefundAmt="15420.12">
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">
    <Undly          NoUnderlyings="1"          Sym="-"          UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
    UnderlyingCnfmQty="121212.15"/>
    <Undly          NoUnderlyings="2"          Sym="-"          UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
    UnderlyingCnfmQty="121212.15"/>
  </SecListAckGrp>
<SecListAckGrp NoRelatedSym="2" ID="XXX" ConfirmedAmt="14520.13" RefundAmt="15420.12">
  <Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1">
    <Undly          NoUnderlyings="1"          Sym="-"          UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
    UnderlyingCnfmQty="121212.15"/>
    <Undly          NoUnderlyings="2"          Sym="-"          UnderlyingCnfmSecurityID="XXX"
    UnderlyingCnfmQty="121212.15"/>
  </SecListAckGrp>
  .....
</SecList>
</IMIXML>

```

### 5.3.13 现金部分结算明细

发行人在工作日日终或开盘前，批量将现金部分结算明细信息传输给中国外汇交易中心。  
 现金部分结算明细文件目录结构及命名请见4.4章节。

#### 5.3.13.1 现金部分结算明细业务要素

现金部分结算明细业务要素见表XXX。

表39 现金部分结算明细业务要素

字段	IMIX 对应	XML 名称	是否必填	说明
生成日期	60TransactTime	TxnTm	是	格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
业务代码	12096TransType	TransType	是	枚举值： 1-现金差额退补 2-现金差额 3-现金替代退补 4-现金替代 5-价外手续费 6-现金分红 7-小额赎回金额
产品代码	使用 Instrument 组件 48 SecurityID	使用 Instrmt 组件 ID	是	文本，最大长度 32 位
成交编号	17ExecID	ExecID	是	文本，最大长度 24

				位 业务代码为 4-现金 替代和 6-现金分红 时不传输
机构 21 位码	使用 Parties 组件 当 452 PartyRole=1 时, 448 PartyID 的值	使用 Pty 组件 当 R=1 时, ID 的值	是	文本,填写投资人在 中国外汇交易中心 的 21 位编码
结算日期	64SettlDate	SettlDt	是	格式: YYYYMMDD
应收款标志	54Side	Side	是	枚举值: R-发行人应收 P-发行人应付
金额	119 SettlCurrAmt	SettlCurrAmt	是	数值, 最大长度 18 位, 精度 2, 单位: 元 非负数
应收款币种	120 SettlCurrency	SettlCcy	是	取值: CNY、USD、EUR、 JPY、HKD、GBP、AUD、 NZD、SGD、CHF、CAD、 MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、 HUF、PLN、DKK、SEK、 NOK、TRY、MXN、THB

## 5.3.13.2 现金部分结算明细 IMIX 报文标准

现金部分结算明细IMIX报文标准见表XXX。

表40 现金部分结算明细 IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>						
8				BeginString	IMIX. 2. 0	IMIX 协议版本
9				BodyLength	20	报文体长度
35				MsgType	BQ	报文类型 BQ-SettlementObligationReport
34				MsgSeqNum	1	报文序列号
49				SenderCompID	XXX	报文发送方
50				SenderSubID	XXX	报文发送方子标识
56				TargetCompID	XXX	报文接收方
52				SendingTime	20180529-12:30:03	报文发送时间
<b>MessageBody</b>						
10490				SettlReportType	6	6-现金部分结算明细

60				TransactTime	20190812-12:12:14	生成日期 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS 前八位表示生成日期
17				ExecID	XXXXXXXX	成交编号 文本，最大长度 24 位 业务代码为 XX-现金替代 和 XX-现金分红时不传输
<b>SettlObligationInstruction</b>						
1165				NoSettlOblig	1	
→	120			SettlCurrency	CNY	应收款币种 取值：CNY、USD、EUR、 JPY、HKD、GBP、AUD、NZD、 SGD、CHF、CAD、MYR、RUB ZAR、KRW、AED、SAR、HUF、 PLN、DKK、SEK、NOK、TRY、 MXN、THB
→	64			SettlDate	20190812	结算日期 格式：YYYYMMDD
→	54			Side	P	应收款标志 枚举值： R-发行人应收 P-发行人应付
→	12096			TransType	1	业务代码 枚举值： 1-现金差额退补 2-现金差额 3-现金替代退补 4-现金替代 5-价外手续费 6-现金分红 7-小额赎回金额
→	119			SettlCurrAmt	12000.12	金额 数值，最大长度 18 位， 精度 2，单位：元 非负数
→	<b>Instrument</b>					
→	48			SecurityID	XXXX	产品代码 文本，最大长度 32 位
→	<b>Parties</b>					
→	453			NoPartyIDs	1	重复组次数
→	→	448		PartyID	XXX	机构 21 位码

						文本, 填写投资人在中国 外汇交易中心的 21 位编 码
→	→	452		PartyRole	1	1-机构
<b>StandardTrailer</b>						
10				Checksum	XXX	校验和

### 5.3.13.3 现金部分结算明细 XML 消息示例

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

```
<!--
```

Description:现金部分结算明细

SettlObligation 节点对应现金部分结算明细 IMIX 报文标准中的结构, 以 SettlReportType=6, 标识该消息为现金部分结算明细消息

可以 SettlObligation 为最外层节点, 传输多个现金部分结算明细信息, SettlObligationNum 为实际传输的现金部分结算明细数量

```
-->
```

```
<IMIXML>
```

```
<SettlObligationList SettlObligationNum="2">
```

```
<SettlObligation
```

```
SettlReportType="6"
```

```
TxnTm="20190812-12:12:14"
```

```
ExecID="XXX">
```

```
<SettlObligationInstruction NoSettlOblig="1" SettlCcy="CNY" SettlDt="20190812" Side="P" TransType="1"
```

```
SettlCurrAmt="12000.12">
```

```
<Instrmt ID="XXX"/>
```

```
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
```

```
</SettlObligationInstruction>
```

```
</SettlObligation>
```

```
<SettlObligation
```

```
SettlReportType="6"
```

```
TxnTm="20190812-12:12:14"
```

```
ExecID="XXX">
```

```
<SettlObligationInstruction NoSettlOblig="1" SettlCcy="CNY" SettlDt="20190812" Side="P" TransType="1"
```

```
SettlCurrAmt="12000.12">
```

```
<Instrmt ID="XXX"/>
```

```
<Pty NoPartyIDs="1" ID="XXX" R="1"/>
```

```
</SettlObligationInstruction>
```

```
</SettlObligation>
```

```
.....
```

```
</SettlObligationList>
```

```
<IMIXML>
```

## 参 考 文 献

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