

新平台本币交易接口开发指南 (现券市场)

CFETS/K1773—2019

第四卷：点击成交与指示性报价交易流程

(2.0.0)

目 次

前言	III
引 言	IV
修改历史	V
1 文档使用说明	1
1.1 文档用途	1
1.2 文档结构	1
2 点击成交与指示性报价交易流程	3
2.1 整体流程	3
2.2 做市报价交易流程	4
2.2.1 做市方	4
2.2.1.1 场景一：发送报价-达成交易	4
2.2.2 会员	7
2.2.2.1 场景二：订阅/取消订阅行情	7
2.2.2.2 场景三：FAK 订单	8
2.3 指示性报价交易流程	9
2.3.1 场景一：发送报价	9
2.3.2 场景二：发送报价-撤销报价	10
2.3.3 场景三：订阅/取消订阅行情	11
3 现券买卖	14
3.1 报价业务要素	14
3.2 Quote (S)	21
3.2.1 做市报价	21
3.2.1.1 IMIX 报文示例	21
3.2.2 指示性报价	24
3.2.2.1 IMIX 报文示例	24
3.2.2.2 使用场景	27
3.3 QuoteStatusReport (AI)	29
3.3.1 IMIX 报文示例	29
3.4 QuoteCancel (Z)	34
3.4.1 做市报价	34
3.4.1.1 IMIX 报文示例	34
3.4.2 指示性报价	35
3.4.2.1 IMIX 报文示例	35
3.5 NewOrderSingle (D)	35
3.5.1 IMIX 报文示例	35
3.6 ExecutionReport (8)	37
3.6.1 FAK 订单反馈	37
3.6.1.1 IMIX 报文示例	37

3.6.2	成交通知	38
3.6.2.1	IMIX 报文示例	38
3.7	做市报价市场深度行情订阅	39
3.7.1	业务要素	39
3.7.2	MarketDataRequest (V)	41
3.7.2.1	IMIX 报文示例	41
3.7.3	ListMarketDataAck (U100)	42
3.7.3.1	IMIX 报文示例	42
3.7.4	MarketDataSnapshotFullRefresh (W)	43
3.7.4.1	IMIX 报文示例	43
3.8	指示性报价市场深度行情订阅	51
3.8.1	业务要素	51
3.8.2	MarketDataRequest (V)	53
3.8.2.1	IMIX 报文示例	53
3.8.3	ListMarketDataAck (U100)	54
3.8.3.1	IMIX 报文示例	54
3.8.4	MarketDataSnapshotFullRefresh (W)	55
3.8.4.1	IMIX 报文示例	55
4	快速撤单	59
4.1	业务要素	59
4.2	QuickCancel (U20)	59
4.2.1	IMIX 报文示例	59
	参考文献	61
图 1	做市报价交易流程图	3
图 2	指示性报价交易流程图	4
图 3	做市报价场景一时序图	5
图 4	做市报价场景二时序图	8
图 5	做市报价场景三时序图	9
图 6	指示性报价场景一时序图	9
图 7	指示性报价场景二时序图	11
图 8	指示性报价场景三时序图	12
表 1	章节列表	1
表 2	做市报价场景一 IMIX 报文交互	5
表 3	做市报价场景二 IMIX 报文交互	8
表 4	做市报价场景三 IMIX 报文交互	9
表 5	指示性报价场景一 IMIX 报文交互	9
表 6	指示性报价场景二 IMIX 报文交互	11
表 7	指示性报价场景三 IMIX 报文交互	12
表 8	现券买卖报价业务要素	14
表 9	Quote IMIX 报文标准	21
表 10	Quote IMIX 报文标准	24
表 11	Quote 报文使用场景	27

表 12	QuoteStatusReport IMIX 报文标准	29
表 13	QuoteCancel IMIX 报文标准	34
表 14	QuoteCancel IMIX 报文标准	35
表 15	NewOrderSingle IMIX 报文标准	35
表 16	ExecutionReport IMIX 报文标准	37
表 17	ExecutionReport IMIX 报文标准	38
表 18	做市报价市场深度行情业务要素	39
表 19	MarketDataRequest IMIX 报文标准	41
表 20	ListMarketDataAck IMIX 报文标准	42
表 21	MarketDataSnapshotFullRefresh IMIX 报文标准	43
表 22	指示性报价市场深度行情业务要素	51
表 23	MarketDataRequest IMIX 报文标准	53
表 24	ListMarketDataAck IMIX 报文标准	54
表 25	MarketDataSnapshotFullRefresh IMIX 报文标准	55
表 26	快速撤单业务要素	59
表 27	QuickCancel IMIX 报文标准	59

前 言

本文件依据新平台本币交易接口业务需求起草。

本文件由中国外汇交易中心归口。

本文件提出单位：中国外汇交易中心。

本文件负责起草单位：中国外汇交易中心。

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

引 言

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

修改历史

人员	审核人	版本号	协议包版本	日期	修改内容
冉杨鋈		0.0.1		2018/3/30	1. 创建文档。
李云毅、赵晓韵、江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.0	1.138.0-2.8.3	2018/4/9	1. 正式发布，升级版本号。
江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.1	1.139.3-2.10.0	2018/8/10	1. 2.2.1.2 做市报价交易流程场景二：发送报价-撤销报价、2.3.2 指示性报价交易流程场景二：发送报价-撤销报价章节，增加接收前台修改通知。 2. 3.1 现券买卖报价业务要素章节，删除字段“原报价编号”；字段“用户参考数据1-6”增加说明：长度不超过 20 个字节。 3. 3.2 Quote (S) 章节，IMIX 报文示例中字段“结算方式”说明改为“该场景固定取值为 2”。 4. 3.2.2 使用场景，表“Quote 报文使用场景”，修改字段“买入/卖出结算方式、买入/卖出清算类型、买入/卖出未成交量”的必传属性。 5. 3.4NewOrderSingle (D)、3.5.1 FAK 订单反馈章节，新增 FAK 订单消息增加字段“清算类型”。 6. 3.5.1 FAK 订单反馈章节，订单提交失败时传输字段改为：市场、客户参考编号、操作状态、操作状态、错误代码、错误原因、业务发生时间。 7. 3.7.2 MarketDataRequest (V)、3.7.3 ListMarketDataAck (U100) 章节，增加字段“本方交易账户 21 位码”。 8. 字段“客户参考编号”改为“有则必传”，涉及章节 3.2.2 使用场景表“Quote 报文使用场景”中“做市方接收做市报价/指示性报价查询反馈”列；3.5.1FAK 订单反馈；。字段“客户参考编号”改为“报价过期不传，报价正常和撤销时有则必传”。字段“原客户参考编号”改为“有则必传”，涉及章节 3.3.1QuoteCancel (Z) IMIX 报文示例。 9. 通篇将“机构 21 位码”改为“交易账户 21

					位码”。
江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/23	<ol style="list-style-type: none"> 3.2.2 使用场景章节，表“Quote 报文使用场景”，“做市方新增做市报价/指示性报价、做市方接收做市报价/指示性报价状态更新”列，字段“最大显示券面总额”传输逻辑改为“指示性报价不传，做市报价选传；指示性报价不传，做市报价正常时选传报价过期和撤销时不传”。 3.5.1 FAK 订单反馈章节，不传“订单编号”改传“做市报价编号”，文档中涉及的“订单编号”均删除。
江云南	冉杨鋈 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/29	<ol style="list-style-type: none"> 4 快速撤单章节，增加快速撤单成功或失败时的反馈消息说明。
江云南	冉杨鋈 邓可欣 杨帆	1.0.3	1.140.3-2.10.3	2018/11/24	<ol style="list-style-type: none"> 其他卷有更新，同步升级版本号。
江云南	唐军敏 冉杨鋈 杨帆	1.0.4	1.140.3-2.10.3	2018/12/19	<ol style="list-style-type: none"> 3.2.2 Quote (S) 使用场景章节，“做市方接收做市方报价/指示性报价状态更新”列，字段“买入/卖出券面总额、买入/卖出交易金额、买入/卖出应计利息总额、买入/卖出结算金额”传输规则改成“指示性报价正常时选传，报价过期和撤销时不传；做市报价正常时必传，报价过期和撤销时不传”。字段“用户参考数据 1~6”传输属性改成“报价新增成功反馈时有则必传”。 3.2.2 Quote (S) 使用场景章节，“做市方接收做市报价/指示性报价查询反馈”列，字段“用户参考数据 1~6”删除。 3.7 指示性报价市场深度行情订阅章节，行情订阅和订阅反馈删除字段“本方交易账户 21 位码”。
江云南	唐军敏 冉杨鋈 杨帆	1.0.5	1.140.3-2.10.3	2019/01/02	<ol style="list-style-type: none"> 其他卷有更新，同步升级版本号。
江云南	唐军敏 冉杨鋈 杨帆	2.0.0	1.140.6-2.10.4	2019/01/09	<ol style="list-style-type: none"> 做市报价状态更新增加冻结、激活、更新流程。做市报价状态更新消息类型改成 QuoteStatusReport (AI)。 3.2.1 做市报价章节，新增做市报价消息增加字段“报价来源、市场范围、应急标识、债券类类型名称、债券类型 ID、渠道类型、渠道、待偿期、报价状态说明、场次日期、债券名称、机构中文简称、交易账户中文简称、交易员名称、机构来源、发行人”；“交易账户 21 位码”改成“交易账户 6 位码”；

					<p>字段“结算方式”使用域改成10098LegDeliveryType。以上字段改动同时涉及3.1报价业务要素章节更新。</p> <p>3. 3.3.1 做市报价撤销章节，增加字段“应急标识、机构6位码、交易员ID、交易员名称”，删除字段“原客户参考编号、报价有效时间、债券代码”。</p> <p>4. 3.4 NewOrderSingle (D) 章节，FAK 点击确认消息，增加字段“报价来源、业务发生时间、结算方式、清算速度、点击方机构6位码、点击方交易账户6位码、机构来源”，删除字段“报价类别、报价有效时间、净价、到期收益率、行权收益率、点击方交易账户21位码”。</p> <p>5. 3.5.1 FAK 订单反馈章节，增加字段“订单编号”、删除字段“做市报价编号、操作状态、净价、全价、应计利息、剩余券面总额、清算类型、清算速度、到期收益率、行权收益率、做市方交易账户21位码、交易员ID”。</p> <p>6. 3.5.2 成交通知章节，增加字段“订单编号、买方交易账户6位码、卖方交易账户6位码”、删除字段“业务发生时间、应急标识、交易方向、全价、剩余券面总额、成交金额、应计利息总额、结算金额、结算日、每百元本金额、本金额、用户参考数据1~6、到期收益率、行权收益率、买方交易账户21位码、卖方交易账户21位码”</p> <p>7. 3.6.2 MarketDataRequest (V) 做市报价行情订阅、3.6.3 ListMarketDataAck (U100) 做市报价行情订阅反馈章节，删除字段“本方交易账户21位码”。</p> <p>8. 3.6.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W) 市场深度行情推送章节，字段“结算方式”使用域改成919DeliveryType，字段“交易账户21位码”改成“交易账户6位码”。</p>
--	--	--	--	--	--

第 4 卷-点击成交与指示性报价交易流程

1 文档使用说明

1.1 文档用途

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

本文档是《新平台本币交易接口开发指南》的《第四卷：点击成交与指示性报价交易流程》，对新平台本币交易接口的点击成交与指示性报价交易流程进行介绍，并提供相关报文的详细说明。

1.2 文档结构

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

表1 章节列表

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

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

2 点击成交与指示性报价交易流程

2.1 整体流程

点击成交方式是指做市方发送点击成交价，非做市方点击报价、填写交易量后直接成交的交易方式。点击成交流程包括做市方发送点击报价和非做市方点击确认成交两个环节，报价一经点击即成交。非做市方也可以发送指定价格和交易量的FAK订单，交易系统按照价格优先、时间优先的顺序匹配点击成交价和FAK订单，自动完成交易。

点击成交价包括双边做市报价和指示性报价。双边做市报价是同时在买卖两个方向指定价格和最大可成交量的报价。做市机构通过双边做市报价达成的交易视为做市机构的做市成交。指示性报价是做市机构可发送只含价格、可不含量的双边指示性报价，该报价不可直接点击成交。

做市报价的整体交易流程如下图：

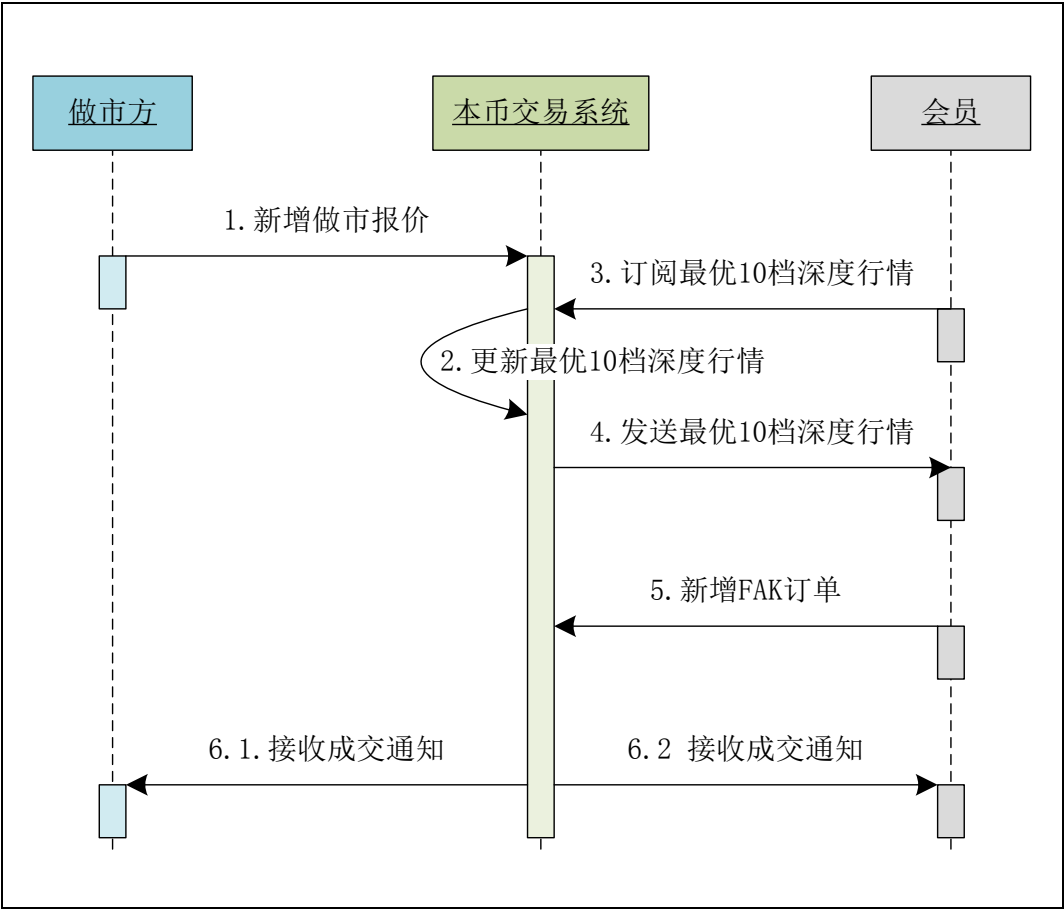


图1 做市报价交易流程图

指示性报价的整体交易流程如下图：

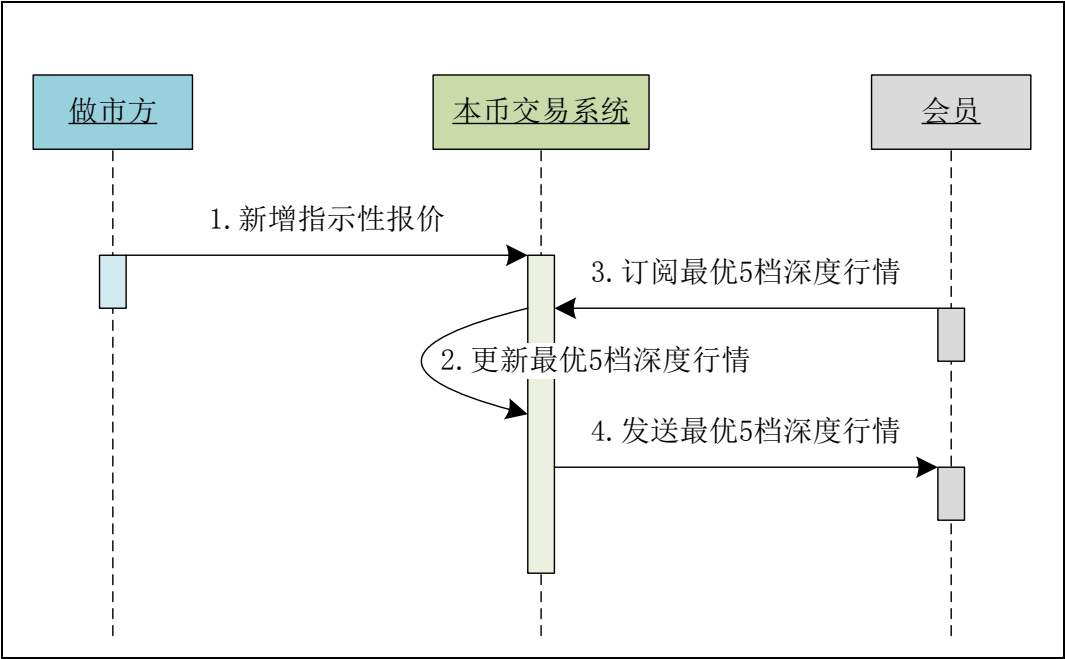


图2 指示性报价交易流程图

2.2 做市报价交易流程

2.2.1 做市方

2.2.1.1 场景一：发送报价-达成交易

做市方通过交易接口新增双边做市报价或对新增的报价进行撤销。非做市方点击成交后，做市方接收成交通知和成交后的报价更新消息。若报价过期，则做市方通过交易接口接收报价过期撤销通知。做市方还可以通过交易接口接收前台修改、冻结、激活的报价状态更新通知。

业务时序图如下：

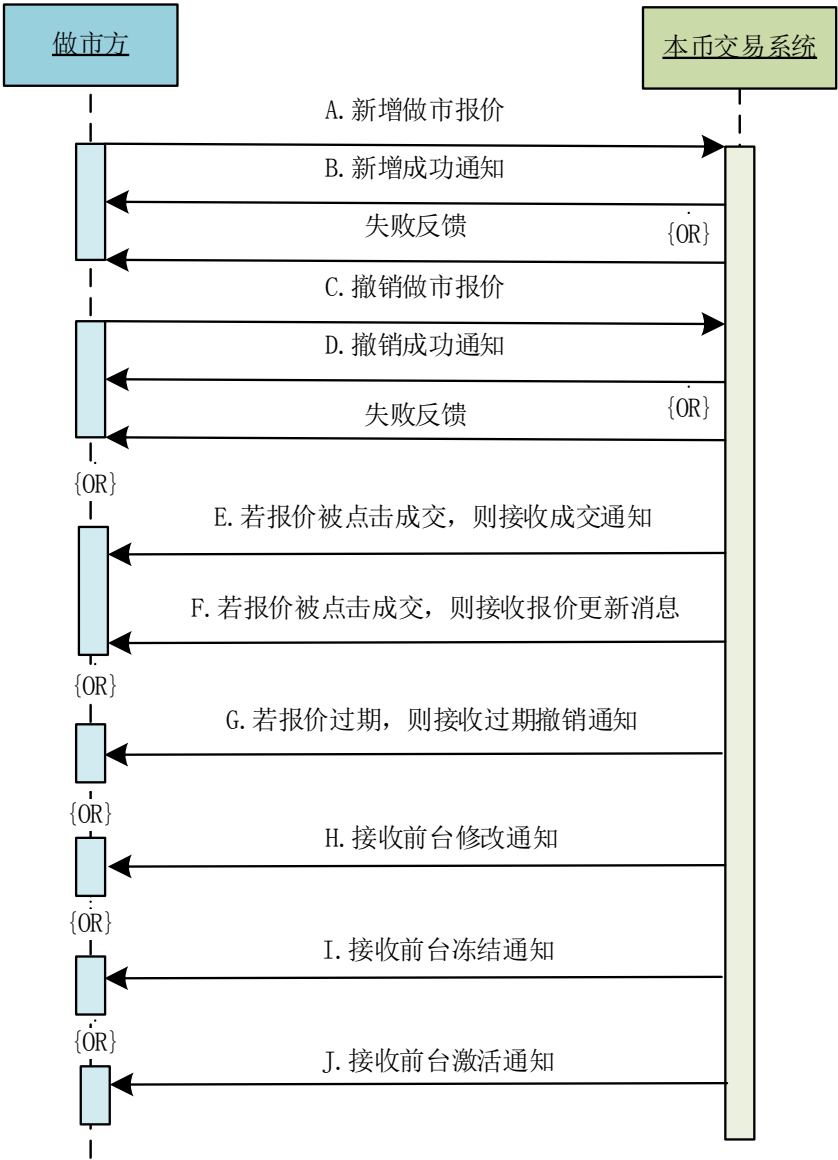


图3 做市报价场景一时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表2 做市报价场景— IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 新增做市报价	做市方	→	S - Quote QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteTransType (10272)=N (新增) ClOrdID (11)=①	本币交易系统
(B) 接收本方新增做市报价成功通知		←	AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价)	

IMIX 2.0				
			QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=N (新增) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=③ ClOrdID (11)=①	
(C) 若撤销做市报价	→		Z - QuoteCancel QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=③ ClOrdID (11)=④	
(D) 接收撤销做市报价成功通知	←		AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteTransType (10272)=C (撤销) QuoteStatus (297)=19 (撤销) QuoteStatusDesc (11988)=19 (正常撤销)/103 (用户终止被撤销)/104 (机构终止被撤销) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑤ ClOrdID (11)=④	
(E) 若新增的做市报价被点击成交, 则接收成交通知	←		8 - ExecutionReport TradeMethod (10317)=5 (点击成交) ExecType (150)=F (正常) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑥	
(F) 若新增的做市报价被点击成交, 则接收成交后的报价更新消息	←		AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteStatus (297)=16 (正常)/107 (全部成交) QuoteTransType (10272)=U (更新) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑦ ClOrdID (11)=①	
(G) 若在做市报价有效时间之后未被全部成交, 则接收过期撤销通知	←		AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteTransType (10272)=E (过期) QuoteStatus (297)=19 (撤销) QuoteStatusDesc (11988)=6 (过期撤销) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑧ ClOrdID (11)=①	

IMIX 2.0			
(H) 若通过前台客户端修改做市报价， 则接收修改成功通知	←	AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=R (修改) (客户端) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑨	
(I) 若通过前台客户端冻结做市报价， 则接收冻结成功通知		AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteStatus (297)=23 (冻结) QuoteTransType (10272)=5 (冻结) (客户端) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑩	
(J) 若通过前台客户端激活做市报价， 则接收激活成功通知		AI - QuoteStatusReport QuoteType (537)=107 (做市报价) QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=6 (激活) (客户端) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑪	

2.2.2 会员

2.2.2.1 场景二：订阅/取消订阅行情

具有行情订阅权限的会员通过交易接口订阅/取消订阅做市报价深度行情。
业务时序图如下：

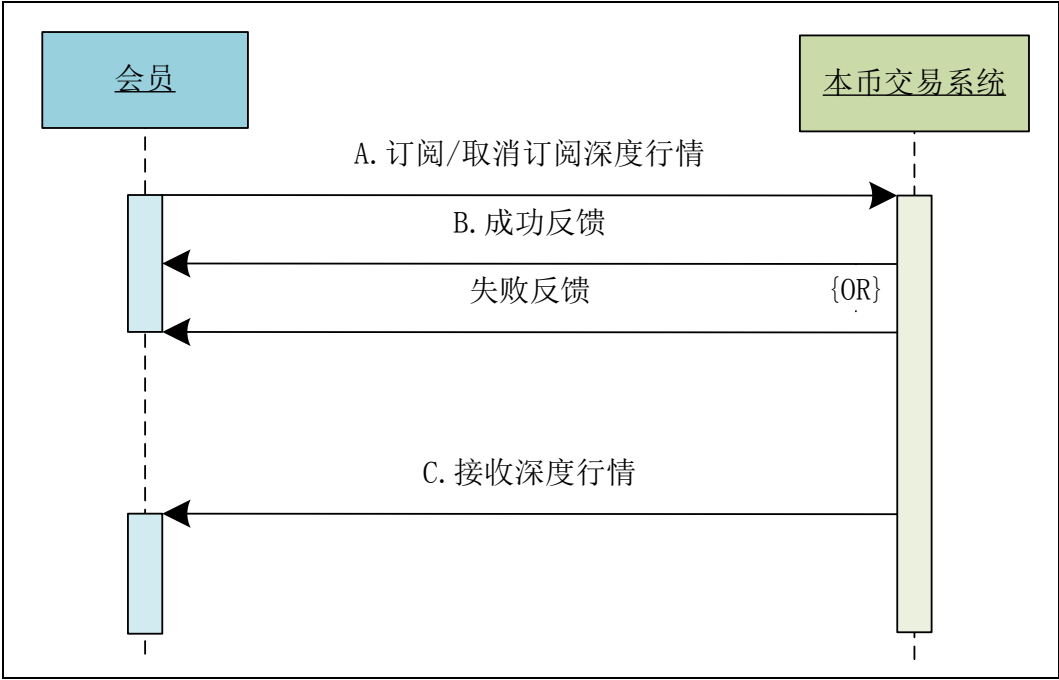


图4 做市报价场景二时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表3 做市报价场景二 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 订阅行情/取消订阅	会员	→	V-MarketDataRequestMDBookType MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=123 (做市报价) SubscriptionRequestType (263)=1 (订阅)/2 (取消订阅) MDReqID (262)=①	本币交易系统
(B) 接收行情订阅反馈消息		←	U100 - ListMarketDataAck MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=123 (做市报价) SubscriptionRequestType (263)=1 (订阅)/2 (取消订阅) SubscriptionStatus (10686)=0 (成功)/1 (失败) MDReqID (262)=①	
(C) 接收现券深度行情		←	W-MarketDataSnapshotFullRefresh MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=123 (做市报价) QuoteEntryID (299)=② MDEntryDate (272)=③ MDEntryTime (273)=④	

2.2.2.2 场景三：FAK 订单

具有点击成交权限的会员可通过交易接口新增FAK订单。
业务时序图如下：

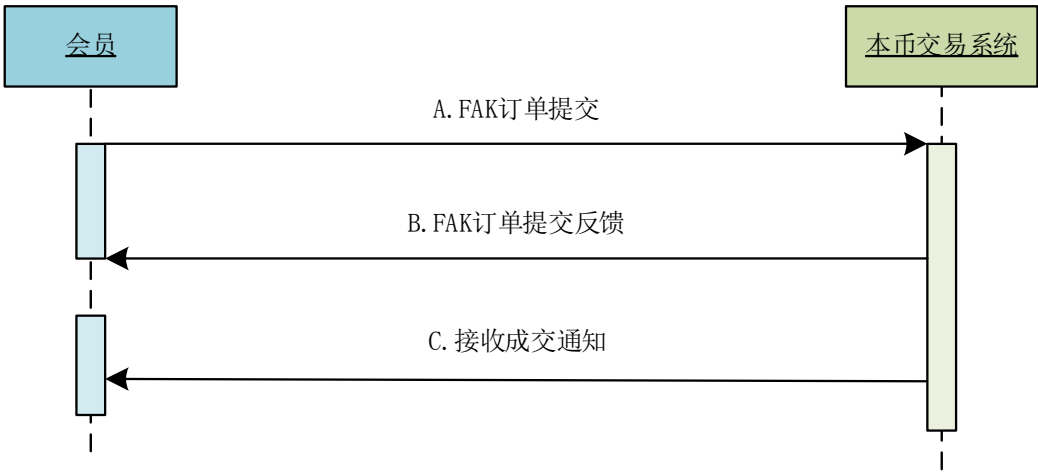


图5 做市报价场景三时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表4 做市报价场景三 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 新增 FAK 报价	会员	→	D - New Order Single OrdType(40)=b (FAK) ClOrdID(11)=① QuoteID(117)=②	本币交易系统
(B) 接收新增 FAK 报价成功反馈		←	8 - ExecutionReport ExecAckStatus(1036)=1(成功)/2(失败) ClOrdID(11)=① QuoteID(117)=②	
(C) 接收成交通知		←	8 - ExecutionReport QuoteID(117)=② ExecID(17)=③	

2.3 指示性报价交易流程

2.3.1 场景一：发送报价

做市方通过交易接口新增指示性报价。若报价过期，则做市方通过交易接口接收报价过期撤销通知。

业务时序图如下：

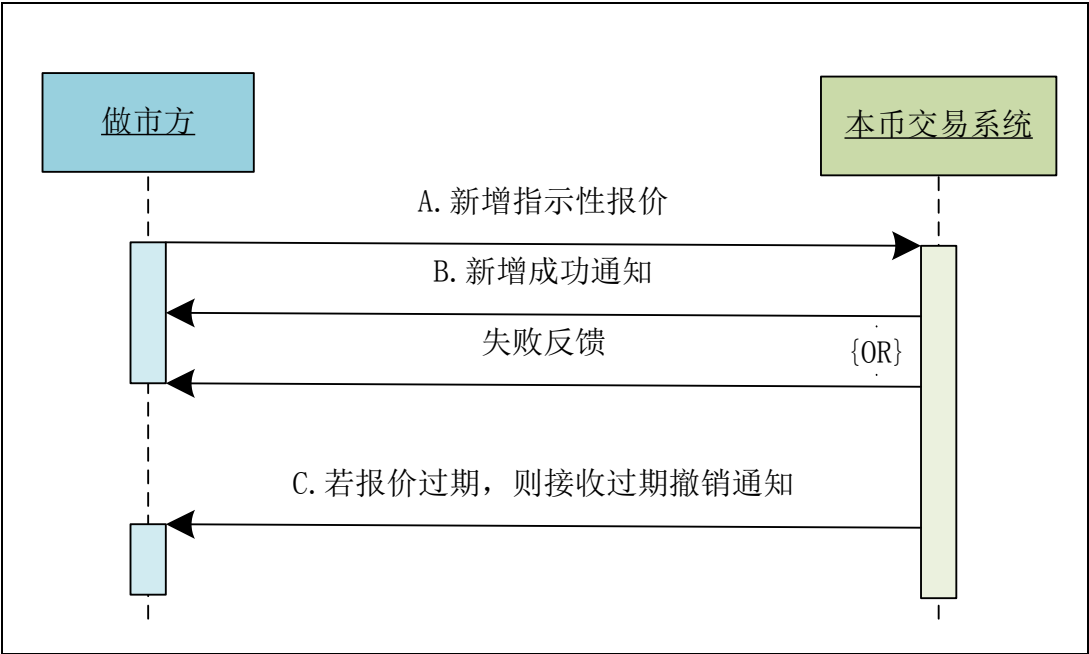


图6 指示性报价场景一时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表5 指示性报价场景一 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 新增指示性报价	做市方	→	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteTransType (10272)=N (新增) ClOrdID (11)=①	本币交易系统
(B) 接收本方新增指示性报价成功通知		←	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=N (新增) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=③ ClOrdID (11)=①	
(C) 若指示性报价过期, 则接收过期撤销通知		←	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteStatus (297)=21 (过期) QuoteID (117)=② TransactTime (60)=⑥ ClOrdID (11)=①	

2.3.2 场景二：发送报价-撤销报价

做市方通过交易接口新增指示性报价。做市方可通过接口撤销本方的报价。
业务时序图如下：

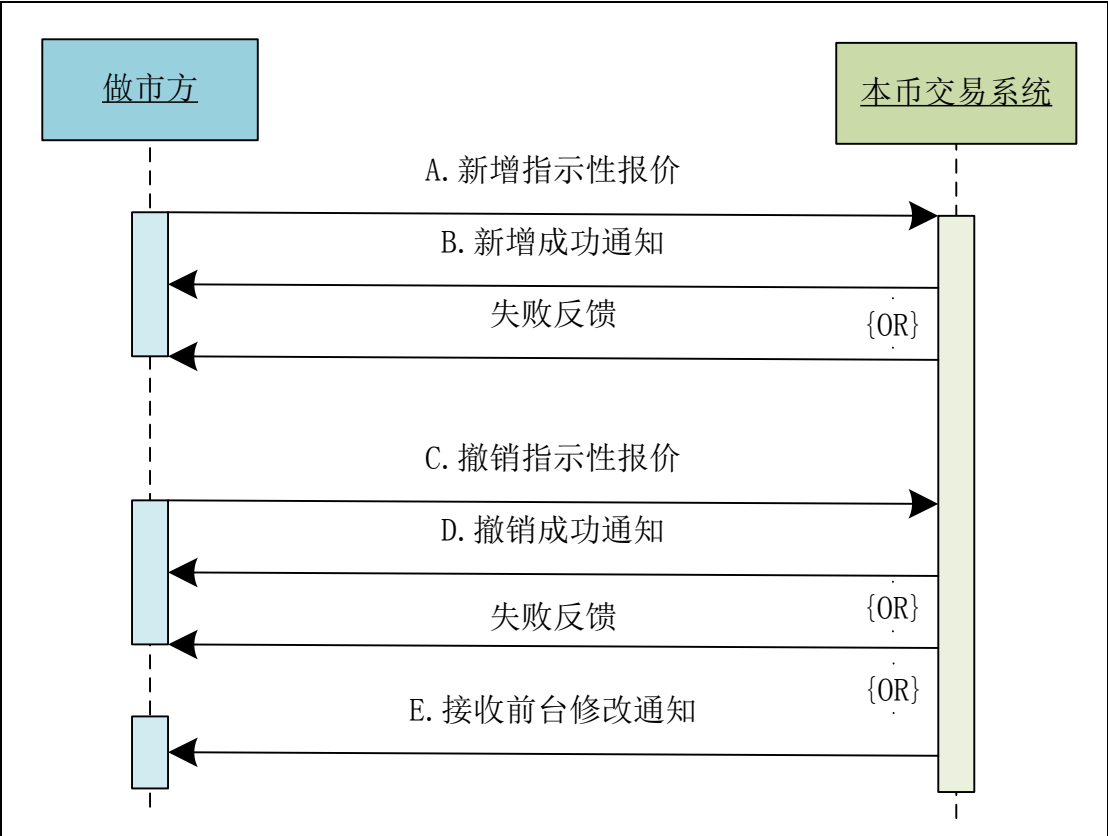


图7 指示性报价场景二时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表6 指示性报价场景二 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 新增指示性报价	做市方	→	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteTransType (10272)=N (新增) ClOrdID(11)=①	本币交易系统
(B) 接收本方新增指示性报价成功通知		←	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=N (新增) QuoteID(117)=② TransactTime (60)=③ ClOrdID(11)=①	
(C) 若撤销指示性报价		→	Z - QuoteCancel QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteID(117)=② TransactTime (60)=③ ClOrdID(11)=④ OrigClOrdID(41)=①	
(D) 接收撤销指示性报价成功通知		←	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteStatus (297)=19 (撤销) QuoteID(117)=② TransactTime (60)=⑤ ClOrdID(11)=④	
(E) 若通过前台客户端修改指示性报价，则接收修改成功通知		←	S - Quote QuoteType (537)=117 (指示性报价) QuoteStatus (297)=16 (正常) QuoteTransType (10272)=R (修改) (客户端) QuoteID(117)=② TransactTime (60)=⑥	

2.3.3 场景三：订阅/取消订阅行情

具有权限的会员订阅/取消订阅指示性报价深度行情。
业务时序图如下：

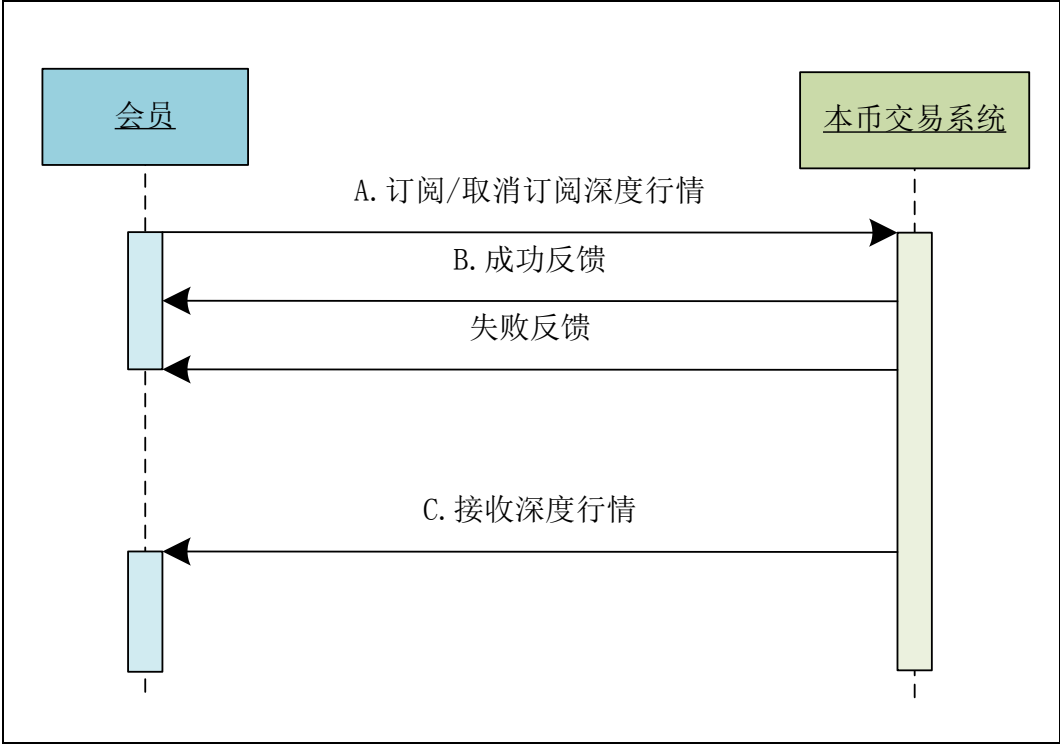


图8 指示性报价场景三时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表7 指示性报价场景三 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A) 订阅行情/取消订阅	非 做 市 方	→	V-MarketDataRequestMDBookType MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=124 (指示性报价) SubscriptionRequestType (263)=1 (订阅)/2 (取消订阅) MDReqID (262)=①	本 币 交 易 系 统
(B) 接收行情订阅反馈消息		←	U100 - ListMarketDataAck MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=124 (指示性报价) SubscriptionRequestType (263)=1 (订阅)/2 (取消订阅) SubscriptionStatus (10686)=0 (成功)/1 (失败) MDReqID (262)=①	
(C) 接收现券深度行情		←	W-MarketDataSnapshotFullRefresh MDBookType (1021)=2 (深度行情) MDSubBookType (1173)=124 (指示性报价) MDEntryDate (272)=③ MDEntryTime (273)=④	

3 现券买卖

本章节对现券买卖市场的点击成交与指示性报价交易流程进行详细介绍，包括现券买卖市场的业务要素和相关报文的示例说明。

3.1 报价业务要素

表8 现券买卖报价业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
市场	10176MarketIndicator	枚举值： 4-现券买卖	
报价来源	10687 DataSourceString	取值： 2-API	
市场范围	11914 MarketScope	枚举值： 1-银行间市场 2-自贸区	
债券类型名称	107 SecurityDesc	文本 国债 央行票据 政策性金融债 企业债 次级债 短期融资券 商业银行普通金融债 国际开发机构债 混合资本债 中期票据 地方政府债 财务公司债 证券公司债 证券公司短期融资券 集合票据 金融租赁公司金融债 政府支持机构债券 汽车金融公司金融债 超短期融资券 同业存单 定向工具 政府支持债券 资产管理公司金融债 二级资本工具 项目收益票据 保险公司资本补充债 项目收益债券 大额存单	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
		信用风险缓释凭证 外国主权政府人民币债券 外国地方政府人民币债券 资产支持证券 资产支持票据 绿色债务融资工具 信用联结票据 其他金融债	
债券类型 ID	11990 SecurityTypeID	字符串 例如:110022	6 位码
机构来源	803PartySubIDType	枚举值: 29-机构来源	
	523PartySubID	CFETS	
发行人	452 PartyRole	枚举值: 206-发行人	债券的发行人机构代码, ABS 为发起人机构代码, 6 位码
	803PartySubIDType	枚举值: 135-机构代码	
	523PartySubID	文本	
渠道类型	11910ChannelType	枚举值: 4-交易中心	
渠道	11911Channel	取值: CFETS	
待偿期	11989 TermToMaturityString	纯文本格式 非含权债: 小于 1 年格式为 xxxD, 大于 1 年格式为 x. xxY; 含权债: 距最近行权日小于 1 年格式为 xxxD+x. xxY, 距最近行权日大于 1 年格式为 x. xxY+x. xxY	
报价类别	537 QuoteType	枚举值: 107-做市报价 117-指示性报价	
操作类型	10272 QuoteTransType	枚举值: N-新增 R-修改 U-更新 5-冻结 6-激活 C-撤销 E-过期	详细使用方法, 参见“2. 点击成交交易流程”章节。

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
报价状态	297 QuoteStatus	枚举值： 16-正常 19-撤销 23-冻结 21-过期 107-全部成交	
报价状态说明	11988 QuoteStatusDesc	枚举值： 19-正常撤销 103-用户终止被撤销 104-机构终止被撤销 6-过期撤销	
报价有效时间	62 ValidUntilTime	格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss 例如： 20070822-12:33:00.000	
场次日期	10039 DateConfirmed	格式： YYYYMMDD	
客户参考编号	11 ClOrdID	字符串 例如： ODAAAABBBB12345678	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。 报价/成交场景：上行消息对应的客户参考编号 查询场景：需要查询的客户参考编号
查询请求编号	10168 QueryRequestID	字符串	
原客户参考编号	41 OrigClOrdID	字符串 例如： ODAAAABBBB12345677	详细使用方法，参见“2. 点击成交与指示性报价交易流程”章节。
报价编号	117 QuoteID	字符串 例如： 201701010420000001	交易系统反馈的报价编号 详细使用方法，参见“2. 点击成交与指示性报价交易流程”章节。
操作状态	1036 ExecAckStatus	枚举值： 1-成功 2-失败	
订单编号	37 OrderID	文本	
错误代码	11251 ApplErrorCode	字符串	
错误原因	11261 ApplErrorDesc	文本	
业务发生时间	60 TransactTime	格式为： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	交易系统反馈的业务发生时间。

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
			详细使用方法, 参见“2. 点击成交与指示性报价交易流程”章节。
报价发送时间	10271 QuoteTime	格式为: YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss	
债券代码	48 SecurityID	字符串 例如: 170001	
债券名称	55 Symbol	字符串 例如: 17 付息国债 01	
交易方向	54 Side	枚举值: 1-买入 2-卖出	报文发送方的交易方向
到期收益率	235 YieldType	MATURITY	一、做市报价净价必传; 到期收益率(除 ABS 券、特殊债外)必传; 行权收益率(含权债时)建议传输。 二、指示性报价传输逻辑如下: 1、到期收益率、行权收益率和净价至少存在一个; 2、有净价时以净价为准; 3、若没有净价、有到期收益率, 根据到期收益率推算净价; 4、若没有净价和到期收益率, 由行权收益率推算净价。 5、若为资产支持证券、特殊债, 则净价必填, 不传到期和行权收益率。 6、若结算币种为非 CNY, 则净价和收益率不能互推, 净价必传, 到期收益率、行权收益率选传
	236 Yield	单位: %, 精度: 4 例如: 3.3500	
买入/卖出到期收益率	10136LegStipulationType	YTM	
	10137LegStipulationValue	单位: %, 精度: 4 例如: 3.3500	
行权收益率	233 StipulationType	StrikeYield	
	234 StipulationValue	单位: %, 精度: 4 例如: 3.2500	
买入/卖出行权收益率	10136LegStipulationTyp	StrikeYield	
	10137LegStipulationValue	单位: %, 精度: 4 例如: 3.2500	
净价	44 Price	单位: 与债券币种的单位保持一致, 精度: 4	
买入/卖出净价	566 LegPrice	如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
买入/卖出全价	10100 LegDirtyPrice	单位: 与债券币种的单位保持一致, 精度: 4 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
应计利息	159 AccruedInterestAmt	单位: 与债券币种的单位保持	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
买入/卖出应计利息	10088 LegAccruedInterestAmt	一致, 精度: 5 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
券面总额	38 OrderQty	单位: 与债券币种的单位保持一致, 整数 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
	32 LastQty		
买入/卖出券面总额	685 LegOrderQty	单位: 与债券币种的单位保持一致, 整数 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
买入/卖出已成交券面总额	10458 LegLastQty	单位: 与债券币种的单位保持一致, 整数 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元	
最大显示券面总额	111 MaxFloor	单位: 元, 整数	
买入/卖出交易金额	10138 LegTradeCashAmt	单位: 与债券币种的单位保持一致, 精度: 2 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
买入/卖出应计利息总额	10089 LegAccruedInterestTotalAmt	单位: 与债券币种的单位保持一致, 精度: 2 如: 当债券币种为 USD, 则单位为美元; 当债券币种为 CNY, 则单位为: 元;	
买入/卖出结算金额	10133 LegSettlCurrAmt	单位: 与结算币种的单位保持一致, 精度: 2 如: 当结算币种为 USD, 则单位为美元; 当结算币种为 CNY, 则单位为元;	
结算币种	120 SettlCurrency	例如: USD	
买入/卖出结算币种	675 LegSettlCurrency		
汇率	155 SettlCurrFxRate	精度: 6 位	
买入/卖出汇率	11398 LegSettlCurrFxRate		
结算方式	919 DeliveryType	枚举值:	买卖方向取值一样

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
买入/卖出结算方式	10098 LegDeliveryType	0-券款对付 4-见券付款 5-见款付券	
清算类型	11143 ClearingMethod	枚举值： 6-净额清算 13-全额清算 4001-净额清算或全额清算	买卖方向取值一样
买入/卖出清算类型	11145 LegClearingMethod		
清算速度	63 SettlType	枚举值： 1-T+0 2-T+1	指示性报价的清算速度只支持 T+1
买入/卖出清算速度	587LegSettlType		
结算日	64 SettlDate	格式：YYYYMMDD	
买入/卖出结算日	588 LegSettlDate		
每百元本金额	10239 Principal	单位：元，精度：2	仅在资产支持证券中传输该字段
买入/卖出本金额	10457LegTotalPrincipal	单位：元，精度：2	仅在资产支持证券中传输该字段
发送对象	216 RoutingType	100-北金所 5-银行间 101-债券通 102-群组	做市报价可以填北金所，指示性报价可以填债券通。 目前不支持群组
群组 ID	217 RoutingID	文本	当发送对象取值群组时传输该字段且必传
用户参考数据 1	11405 UserReference1	文本	用户传输自定义信息 长度不超过 20 个字节
用户参考数据 2	11406 UserReference2	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 3	11407 UserReference3	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 4	11498 UserReference4	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 5	11499 UserReference5	文本	长度不超过 20 个字节
用户参考数据 6	11500 UserReference6	文本	长度不超过 20 个字节
做市方标识	452 PartyRole	枚举值： 101-发送方/102 接收方	做市方信息为重复组。 具体取值用法参考报文示例。
做市方交易账户 21 位码	448PartyID	21 位代码	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
做市方机构 6 位码	803PartySubIDType	枚举值： 135-机构 6 位码	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
	523PartySubID	文本	
做市方机构中文简称	803PartySubIDType	枚举值： 125-机构中文简称	
	523PartySubID	文本	
做市方交易账户 6 位码	803PartySubIDType	枚举值： 266-交易账户 6 位码	
	523PartySubID	文本	
做市方交易账户中文简称	803PartySubIDType	枚举值： 267-交易账户中文简称	
	523PartySubID	文本	
做市方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
	523PartySubID	文本	
做市方交易员名称	803PartySubIDType	枚举值： 101-交易员名称	
	523PartySubID	文本	
点击方标识	452 PartyRole	枚举值： 101-发送方	
点击方机构 6 位码	803PartySubIDType	枚举值： 135-机构 6 位码	
	523PartySubID	文本	
点击方交易账户 6 位码	803PartySubIDType	枚举值： 266-交易账户 6 位码	
	523PartySubID	文本	
点击方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	
应急标识	10022 ContingencyIndicator	枚举值： Y-是 N-否	
成交编号	17 ExecID	文本	
交易方式	10317 TradeMethod	枚举值： 5-点击成交	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
成交状态	150 ExecType	枚举值： F-正常	
成交日期	75 TradeDate	格式为： YYYYMMDD	
成交时间	10318 TradeTime	格式为： HH:MM:SS.sss	
买方标识	452 PartyRole	枚举值： 119-买方	
买方交易账户 6 位码	803PartySubIDType	枚举值： 266-交易账户 6 位码	
	523PartySubID	文本	
买方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	
卖方标识	452 PartyRole	枚举值： 120-卖方	
卖方交易账户 6 位码	803PartySubIDType	266-交易账户 6 位码	
	523PartySubID	文本	
卖方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523PartySubID	文本	

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

3.2 Quote (S)

Quote报文用于做市方发送做市报价，发送指示性报价并接收报价状态更新以及查询结果反馈。

3.2.1 做市报价

3.2.1.1 IMIX 报文示例

表9 Quote IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	S	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间 格 式 :

					YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
10687			DataSourceString	2	报价来源，必传 2-API
11914			MarketScope	1	市场范围，必传 枚举值： 1-银行间市场 2-自贸区
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识，必传 默认传否
107			SecurityDesc	国债	债券类型名称，必传
11990			SecurityTypeID	110022	债券类型 ID，必传
11910			ChannelType	4	渠道类型，必传 4-交易中心
11911			Channel	CFETS	渠道，必传 CFETS
11989			TermToMaturityString	100D	待偿期，必传
537			QuoteType	107	报价类别，必传 107-做市报价
10272			QuoteTransType	N	操作类型，必传 N-新增
62			ValidUntilTime	20070820-12:40:00.000	报价有效时间，必传
10039			DateConfirmed	20181129	场次日期，必传
11			ClOrdID	XXX	客户参考编号，必传
48			SecurityID	XXXX	债券代码，必传
55			Symbol	XXX	债券名称，必传
111			MaxFloor	1	最大显示券面总额，选传
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1，选传
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2，选传
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3，选传
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4，选传
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5，选传
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6，选传
555			NoLegs	2	该场景取值固定为 2
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	1	买入
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定,以实际到期收益率和行权收益率是否

					传输为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率, ABS 券、特殊债不传, 其他债券必传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率, 含权债选传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.2500	
→	566		LegPrice	99.1452	净价, 必传
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息, 外币债、特殊债(结算货币非 CNY) 时必传
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额, 必传
→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种, 外币债时必传
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率, 外币债时必传
→	10098		LegDeliveryType	0	结算方式, 必传
→	11145		LegClearingMethod	6	清算类型, 必传
→	587		LegSettlType	1	清算速度, 必传
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	2	2-卖出
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定, 以实际到期收益率和行权收益率是否传输为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率, ABS 券、特殊债不传, 其他债券必传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率, 含权债选传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.2500	
→	566		LegPrice	99.1452	净价, 必传
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息, 外币债、特殊债(结算货币非 CNY) 时必传
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额, 必传
→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种, 外币债时必传
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率, 外币债时必传
→	10098		LegDeliveryType	0	结算方式, 必传
→	11145		LegClearingMethod	6	清算类型, 必传
→	587		LegSettlType	1	清算速度, 必传
453			NoPartyIDs	2	该场景取值固定为 1
→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	452		PartyRole	101	101-发送方(即做市方)
→	802		NoPartySubIDs	7	该场景取固定为 7
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	125	125-机构中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	267	267-交易账户中文简称
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	101	101-交易员名称
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-交易中心
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源
→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	452		PartyRole	206	206-发行人
→	802		NoPartySubIDs	1	该场景取固定为 1
→	→	523	PartySubID	XXXX	发行人机构 6 位码
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码
215			NoRoutingIDs	1	该场景取值固定为 1
→	216		RoutingType	100	发送对象 100-北金所 5-银行间
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.2.2 指示性报价

3.2.2.1 IMIX 报文示例

表10 Quote IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX. 2. 0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	S	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00 . 000	报文发送时间 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
537			QuoteType	117	报价类别 117-指示性报价
10272			QuoteTransType	N	操作类型 N-新增

					R-修改
297			QuoteStatus	19	报价状态 16-正常 19-撤销 21-过期
62			ValidUntilTime	20070820-12:40:00 .000	报价有效时间
11			ClOrdID	XXX	客户参考编号
10168			QueryRequestID	XXXX	查询请求编号（查询场景）
117			QuoteID	XXXX	报价编号
60			TransactTime	20070820-12:40:00. 000	业务发生时间
10271			QuoteTime	20070820-12:40:00. 000	报价发送时间
10022			ContingencyIndicator	N	应急标识
48			SecurityID	XXXX	债券代码
55			Symbol	XXXX	债券名称
10239			Principal	100	每百元本金额
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6
555			NoLegs	2	该场景取值固定为 2
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	1	买入
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定,以实际到期 收益率和行权收益率是否传输 为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率
→	→	10137	LegStipulationValue	3.3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率
→	→	10137	LegStipulationValue	3.2500	
→	566		LegPrice	99.1452	净价
→	10100		LegDirtyPrice	10.0000	全价
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额
→	10138		LegTradeCashAmt	10.00	交易金额
→	10089		LegAccruedInterestTotalAmt	10.00	应计利息总额

→	10133		LegSettlCurrAmt	10.0011	结算金额
→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率
→	587		LegSettlType	1	清算速度
→	588		LegSettlDate	20160314	结算日期
→	10457		LegTotalPrincipal	2000	本金额
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	2	2-卖出
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定,以实际到期收益率和行权收益率是否传输为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率
→	→	10137	LegStipulationValue	3.3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率
→	→	10137	LegStipulationValue	3.2500	
→	566		LegPrice	99.1452	净价
→	10100		LegDirtyPrice	10.0000	全价
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额
→	10138		LegTradeCashAmt	10.00	交易金额
→	10089		LegAccruedInterestTotalAmt	10.00	应计利息总额
→	10133		LegSettlCurrAmt	10.0011	结算金额
→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率
→	587		LegSettlType	1	清算速度
→	588		LegSettlDate	20160314	结算日期
→	10457		LegTotalPrincipal	2000	本金额
Parties					
453			NoPartyIDs	1	该场景取值固定为 1
→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位码
→	452		PartyRole	101	101-发送方（即做市方）
→	802		NoPartySubIDs	1	该场景取值不固定,以实际传输个数为准
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
RoutingGrp					
215			NoRoutingIDs	1	该场景取值固定为 1
→	216		RoutingType	100	发送对象
→	217		RoutingID	XXX	群组 ID
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.2.2.2 使用场景

表11 Quote 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	做市方 新增指示性报价	做市方 接收指示性报价状态更新	做市方 接收指示性报价 查询反馈
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传
报价类别	537 QuoteType	必传	必传	必传
操作类型	10272 QuoteTransType	必传	报价正常时必传 报价过期和撤销时 不传	—
报价状态	297QuoteStatus	—	必传	必传
报价有效时间	62 ValidUntilTime	必传	报价正常时必传 报价过期和撤销时 不传	—
客户参考编号	11C10rdID	必传	报价过期时不传, 报 价正常和撤销时有 则必传	有则必传
查询请求编号	10168 QueryRequestID	—	—	必传
报价编号	117QuoteID	—	必传	必传
业务发生时间	60 TransactTime	—	必传	必传
报价发送时间	10271 QuoteTime	—	—	必传
应急标识	10022 ContingencyIndicator	—	必传	—
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传
债券名称	55 Symbol	—	必传	必传
买入/卖出到期收 益率	当 10136LegStipulationType=YTM 时 10137LegStipulationValue	选传	报价正常时 选传(有 则必传,ABS 券不传、 特殊债不传) 报价过期和撤销时 不传	必传
买入/卖出行权收 益率	当 10136LegStipulationType= STRIKEYEILD 时 10137LegStipulationValue	选传	报价正常时 选传(行 权债有则必传) 报价过期和撤销时 不传	必传
买入/卖出净价	566 LegPrice	选传	报价正常时必传 报价过期和撤销时 不传	必传
买入/卖出全价	10100 LegDirtyPrice	—	报价正常时必传 报价过期和撤销时 不传	—
买入/卖出应计利 息	10088 LegAccruedInterestAmt	选传, 特殊债时 必传	报价正常时必传 报价过期和撤销时	—

业务字段	IMIX 域	做市方 新增指示性报价	做市方 接收指示性报价状态更新	做市方 接收指示性报价 查询反馈
			不传	
买入/卖出券面总额	685 LegOrderQty	选传	报价正常时选传, 报价过期和撤销时不传	选传
买入/卖出交易金额	10138LegTradeCashAmt	-	报价正常时选传, 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出应计利息总额	10089 LegAccruedInterestTotalAmt	-	报价正常时选传, 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出结算金额	10133 LegSettlCurrAmt	-	报价正常时选传, 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出结算币种	675 LegSettlCurrency	选传, 若不传, 则默认为 CNY	报价正常时必传 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出汇率	11398 LegSettlCurrFxRate	选传, 若债券币种和结算币种不一致, 则必传	选传, 若债券币种和结算币种不一致, 当报价正常时必传, 当报价过期和撤销时不传; 若债券币种和结算币种一致, 则报价正常、过期、撤销均不传	-
买入/卖出清算速度	587LegSettlType	必传	报价正常时必传 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出结算日	588 LegSettlDate	-	报价正常时必传 报价过期和撤销时不传	-
买入/卖出本金额	10457LegTotalPrincipal	-	报价正常时仅 ABS 传 报价过期和撤销时不传	-
每百元本金额	10239 Principal	-	报价正常时仅 ABS 传 报价过期和撤销时不传	-
用户参考数据 1	11405 UserReference1	选传	报价新增成功反馈时有则必传	-
用户参考数据 2	11406 UserReference2	选传	报价新增成功反馈	-

业务字段	IMIX 域	做市方 新增指示性报价	做市方 接收指示性报价状 态更新	做市方 接收指示性报价 查询反馈
			时有则必传	
用户参考数据 3	11407 UserReference3	选传	报价新增成功反馈 时有则必传	-
用户参考数据 4	11498 UserReference4	选传	报价新增成功反馈 时有则必传	-
用户参考数据 5	11499 UserReference5	选传	报价新增成功反馈 时有则必传	-
用户参考数据 6	11500 UserReference6	选传	报价新增成功反馈 时有则必传	-
做市方交易账户 21 位码	当 452PartyRole=101 时 448PartyID	必传	必传	必传
做市方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	必传	-	必传
发送对象	216 RoutingType	选传, 如不传默 认银行间	选传	选传
群组 ID	217 RoutingID	当发送对象取值 群组时必传	当发送对象取值群 组时必传	当发送对象取值 群组时必传

3.3 QuoteStatusReport (AI)

QuoteStatusReport 报文用于发送做市报价状态更新消息。

3.3.1 IMIX 报文示例

表12 QuoteStatusReport IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	AI	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
537			QuoteType	107	报价类别，必传

					107-做市报价
10272			QuoteTransType	N	操作类型，必传 N-新增 R-修改 U-更新 5-冻结 6-激活 C-撤销 E-过期
297			QuoteStatus	19	报价状态，必传 16-正常 19-撤销 23-冻结 107-全部成交
11988			QuoteStatusDesc	19	报价状态说明 19-正常撤销 103-用户终止被撤销 104-机构终止被撤销 6-过期撤销 报价状态为正常、全部成交、冻结时不传； 报价状态为撤销时必传
62			ValidUntilTime	20070820-12:40:00.000	报价有效时间 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
11			ClOrdID	XXX	客户参考编号 报价状态为正常、全部成交、冻结、撤销时有则必传
117			QuoteID	XXXX	报价编号，必传
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间，必传
48			SecurityID	XXXX	债券代码 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
111			MaxFloor	1	最大显示券面总额 报价状态为正常、全部成交、冻结时选传； 报价状态为撤销时不传
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1，有则必传
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2，有则必传
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3，有则必传
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4，有则必传
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5，有则必传

11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6, 有则必传
555			NoLegs	2	该场景取值固定为 2
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	1	买入
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定, 以实际到期收益率和行权收益率是否传输为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率 报价状态为正常、全部成交、冻结时 ABS 券、特殊债不传, 其他债券必传; 报价状态为撤销时不传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率 报价状态为正常、全部成交、冻结时含权债选传; 报价状态为撤销时不传
→	→	10137	LegStipulationValue	3.2500	
→	566		LegPrice	99.1452	净价 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10.00000	应计利息 报价状态为正常、全部成交、冻结时外币债、特殊债(结算货币非 CNY) 时必传; 报价状态为撤销时不传
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传
→	10458		LegLastQty	100000	已成交券面总额 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传
→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种 报价状态为正常、全部成交、冻结时外币债必传; 报价状态为撤销时不传
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率 报价状态为正常、全部成交、冻结时外币债必传; 报价状态为撤销时不传
→	10098		LegDeliveryType	0	结算方式

					报价状态为正常、全部成交、冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	11145		LegClearingMethod	6	清算类型 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	587		LegSettlType	1	清算速度 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	602		LegSecurityID	XXXX	取值与 48 号域一致
→	624		LegSide	2	2-卖出
→	10208		NoLegStipulations	2	该场景取值不固定,以实际到期收益率和行权收益率是否传输为准
→	→	10136	LegStipulationType	YTM	到期收益率 报价状态为正常、全部成交、冻结时 ABS 券、特殊债不传,其他债券必传; 报价状态为撤销时不传
→	→	10137	LegStipulationValue	3. 3500	
→	→	10136	LegStipulationType	STRIKEYEILD	行权收益率 报价状态为正常、全部成交、冻结时含权债选传; 报价状态为撤销时不传
→	→	10137	LegStipulationValue	3. 2500	
→	566		LegPrice	99. 1452	净价 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传
→	10088		LegAccruedInterestAmt	10. 00000	应计利息 报价状态为正常、全部成交、冻结时外币债、特殊债(结算货币非 CNY) 时必传; 报价状态为撤销时不传
→	685		LegOrderQty	200000	券面总额 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传
→	10458		LegLastQty	100000	已成交券面总额 报价状态为正常、全部成交、冻结时必传; 报价状态为撤销时不传

→	675		LegSettlCurrency	USD	结算币种 报价状态为正常、全部成交、 冻结时外币债必传； 报价状态为撤销时不传
→	11398		LegSettlCurrFxRate	1.124514	汇率 报价状态为正常、全部成交、 冻结时外币债必传； 报价状态为撤销时不传
→	10098		LegDeliveryType	0	结算方式 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	11145		LegClearingMethod	6	清算类型 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	587		LegSettlType	1	清算速度 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
453			NoPartyIDs	1	该场景取值固定为 1
→	448		PartyID	-	组件必须域，取值“-”
→	452		PartyRole	101	101-发送方（即做市方）
→	802		NoPartySubIDs	2	该场景取固定为 2
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
215			NoRoutingIDs	1	该场景取值固定为 1
→	216		RoutingType	100	发送对象 100-北金所 5-银行间， 报价状态为正常、全部成交、 冻结时必传； 报价状态为撤销时不传
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

3.4 QuoteCancel (Z)

QuoteCancel报文用于做市方撤销做市报价/指示性报价。

3.4.1 做市报价

3.4.1.1 IMIX 报文示例

表13 QuoteCancel IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9				BodyLength	1	报文长度
35				MsgType	Z	报文类型
34				MsgSeqNum	24	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49				SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50				SenderSubID	XXX	
56				TargetCompID	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
537				QuoteType	107	报价类别，必传 107-做市报价
10022				ContingencyIndicator	N	应急标识
11				ClOrdID	XXX	客户参考编号，必传
117				QuoteID	XXXX	报价编号，必传
60				TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间，必传
295				NoQuoteEntries	1	重复组个数，固定取值为 1
→	55			Symbol	—	组件必须域，取值 “—”
→	10176			MarketIndicator	4	市场标识，必传 4-现券买卖
453				NoPartyIDs	1	该场景取值固定为 1
→	448			PartyID	—	组件必须域，取值 “—”
→	452			PartyRole	101	101-发送方（即做市方）
→	802			NoPartySubIDs	3	重复组个数
→	→	523		PartySubID	XXXX	
→	→	803		PartySubIDType	135	135-机构 6 位码
→	→	523		PartySubID	XXXX	
→	→	803		PartySubIDType	2	2-交易员 ID，必传
→	→	523		PartySubID	XXXX	
→	→	803		PartySubIDType	101	101-交易员名称，必传
StandardTrailer						
10				Checksum	XXX	

3.4.2 指示性报价

3.4.2.1 IMIX 报文示例

表14 QuoteCancel IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9				BodyLength	1	报文长度
35				MsgType	Z	报文类型
34				MsgSeqNum	24	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49				SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50				SenderSubID	XXX	
56				TargetCompID	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
537				QuoteType	107	报价类别, 必传 117-指示性报价
62				ValidUntilTime	20070820-12:40:00.000	报价有效时间, 必传
11				ClOrdID	XXX	客户参考编号, 必传
41				OrigClOrdID	XXX	原客户参考编号, 有则必传
117				QuoteID	XXXX	报价编号, 必传
60				TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间, 必传
295				NoQuoteEntries	1	重复组个数, 固定取值为 1
→	55			Symbol	-	组件必须域, 取值“-”
→	48			SecurityID	XXXX	债券代码, 必传
→	10176			MarketIndicator	4	市场标识, 必传 4-现券买卖
StandardTrailer						
10				Checksum	XXX	

3.5 NewOrderSingle (D)

NewOrderSingle报文用于点击方发送新增FAK订单。

3.5.1 IMIX 报文示例

表15 NewOrderSingle IMIX 报文标准

域号				域名	取值	说明
StandardHeader						
8				BeginString	IMIX.2.0	协议包版本号
9				BodyLength	1	报文长度

35			MsgType	D	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则” 章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场标识，必传 4-现券买卖
10687			DataSourceString	2	报价来源，必传 2-API
11			ClOrdID	XXXX	客户参考编号，必传
117			QuoteID	XXXX	做市报价报价编号，必传
60			TransactTime	20070820-12:40:00.000	业务发生时间，必传
48			SecurityID	XXX	债券代码，必传
54			Side	1	交易方向，必传
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1，选传
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2，选传
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3，选传
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4，选传
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5，选传
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6，选传
38			OrderQty	100000	券面总额，必传
919			DeliveryType	0	结算方式，必传
11143			ClearingMethod	6	清算类型，必传 枚举值： 6-净额清算 13-全额清算
63			SettlType	1	清算速度，必传
453			NoPartyIDs	1	该场景取值固定为 1
→	448		PartyID	-	组件必须域，取值“-”
→	452		PartyRole	101	101-发送方（即点击方）
→	802		NoPartySubIDs	4	固定取值 4
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码，必传
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码，必传
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID，必传
→	→	523	PartySubID	CFETS	CFETS-交易中心
→	→	803	PartySubIDType	29	29-机构来源，必传

StandardTrailer					
10			Checksum	50	

3.6 ExecutionReport (8)

ExecutionReport报文用于点击方接收FAK订单提交反馈，以及交易双方接收成交通知。

3.6.1 FAK 订单反馈

3.6.1.1 IMIX 报文示例

表16 ExecutionReport IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
11			ClOrdID	XXX	客户参考编号，必传
37			OrderID	XXX	订单编号 选传，订单提交成功时传输
1036			ExecAckStatus	1	操作状态，必传 1-成功 2-失败
11251			ApplErrorCode	XXX	错误代码 选传，订单提交失败时传输
11261			ApplErrorDesc	XXX	错误原因 选传，订单提交失败时传输
60			TransactTime	20130618-11:14:00	业务发生时间，必传
11405			UserReference1	XXX	用户参考数据 1 选传，订单提交成功时有则必传
11406			UserReference2	XXX	用户参考数据 2 选传，订单提交成功时有则必传
11407			UserReference3	XXX	用户参考数据 3 选传，订单提交成功时有则必传
11498			UserReference4	XXX	用户参考数据 4

					选传, 订单提交成功时有则必传
11499			UserReference5	XXX	用户参考数据 5 选传, 订单提交成功时有则必传
11500			UserReference6	XXX	用户参考数据 6 选传, 订单提交成功时有则必传
StandardTrailer					
10			Checksum	50	

3.6.2 成交通知

3.6.2.1 IMIX 报文示例

表17 ExecutionReport IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	报文版本
9			BodyLength	1	报文长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场标识，必传 4-现券买卖
17			ExecID	XXX	成交编号，必传
10317			TradeMethod	5	交易方式，必传 5-点击成交
150			ExecType	F	成交状态，必传 F-正常
75			TradeDate	20151209	成交日期，必传
10318			TradeTime	18:57:00.000	成交时间，必传
117			QuoteID	XXX	做市报价报价编号，必传
37			OrderID	XXX	订单编号，必传
48			SecurityID	XXXX	债券代码，必传
44			Price	0.0810	净价，必传
159			AccruedInterestAmt	100.00000	应计利息，外币债（结算币种非 CNY）、特殊债时必传
32			LastQty	10000	券面总额，必传
120			SettlCurrency	USD	结算币种，有则必传
155			SettlCurrFxRate	1.123456	汇率，有则必传
919			DeliveryType	0	结算方式，必传

11143			ClearingMethod	6	清算类型, 必传
63			SettlType	1	清算速度, 必传
453			NoPartyIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	452		PartyRole	119	119-买方
→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码, 必传
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID, 必传
→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	452		PartyRole	120	120-卖方
→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码, 必传
→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID, 必传
Standard Trailer					
10			Checksum	50	

3.7 做市报价市场深度行情订阅

3.7.1 业务要素

表18 做市报价市场深度行情业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
行情类型	1021 MDBookType	枚举值: 2-市场深度行情	使用 1021 和 1173 组合表示 行情类型为做市报价市场深度行情
	1173 MDSubBookType	123-做市报价	
市场	10176MarketIndicator	枚举值: 4-现券买卖	
订阅标识	263 SubscriptionRequestType	枚举值: 1-订阅 2-取消订阅	
债券类型	167SecurityType	枚举值: TB-国债 PFB-政策性金融债 CBB-央行票据 GBAB-政府支持机构债券 CP-短期融资券 MTN-中期票据 CORP-企业债 CD-同业存单 SCP-超短期融资券	

		ABS-资产支持证券 Other-其它	
债券代码	48 SecurityID	字符串	
债券名称	55 Symbol	文本	
订阅请求 ID	262 MDReqID	例如： MDAAAABBBB00000001	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
订阅状态	10686 SubscriptionStatus	枚举值： 0-成功 1-失败	
错误代码	11251 ApplErrorCode	字符串	
错误原因	11261 ApplErrorDesc	文本	
本方机构 21 位代码	448PartyID 452PartyRole 取值 1 表示机构		参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
清算速度	63 SettlType	枚举值： 1-T+0 2-T+1	
档位信息	264 MarketDepth	取值固定为 10	
	1023 MDPriceLevel	1 表示第一档； 2 表示第二档； 3 表示第三档； 4 表示第四档； 5 表示第五档； …… m 表示第 m 档	作为各档行情标识头信息： 1、若实际买入只有一档，卖出只有三档，则档位信息（264 号域）仍填写 10，但实际买入只填一档的数据，卖出只填三档的数据； 2、若债券的某个方向行情被点空了或者被全部撤销，档位信息还在，但对应的方向不填数据，若两个方向行情均被点空了或者被全部撤销，档位信息还在，但两个方向均不填数据。 3、若某档位行情不为空，则该档位的行情字段除汇率、到期收益率字段条件必传外，其它均必传。
买入/卖出方向	269 MDEntryType	枚举值： 0-BID 1-OFFER	
报价类别	1070 MDQuoteType	枚举值： 107-做市报价	
报价编号	299 QuoteEntryID		
业务发生时间	272 MDEntryDate	格式为：YYYYMMDD	
	273 MDEntryTime	格式为：HH:MM:SS.sss	

净价	31 LastPx	单位:元, 精度: 4 例如:100000.1234	
到期收益率	235 YieldType	MATURITY	
	236 Yield	单位: %, 精度: 4 例如: 3.3500	
全价	270MDEntryPx	单位: 元, 精度: 4 位	
券面总额	271MDEntrySize	单位: 元, 整数	显示报价剩余量, 若报价是冰山订单, 当报价剩余量大于最大显示券面总额时, 显示最大显示券面总额
清算类型	11143 ClearingMethod	枚举值: 6-净额清算 13-全额清算 4001-净额清算或全额清算	
结算日	64 SettlDate	格式: YYYYMMDD	
结算方式	919 DeliveryType	枚举值: 0-券款对付 4-见券付款 5-见款付券	
结算币种	120 SettlCurrency	例如: USD	
汇率	155 SettlCurrFxRate	精度: 6 位	
做市方交易账户 6 位码	523 PartySubID		
	452PartyRole	枚举值: 101-报价方	
	803 PartySubIDType	266-交易账户 6 位码	
做市方交易员 ID	523 PartySubID		
	803 PartySubIDType	2-交易员 ID	

3.7.2 MarketDataRequest (V)

MarketDataRequest报文用于订阅、取消订阅市场深度行情。

3.7.2.1 IMIX 报文示例

表19 MarketDataRequest IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	固定值, 报文版本号
9			BodyLength	9	报文长度
35			MsgType	V	MarketDataRequest
34			MsgSeqNum	34	报文序列号
52			SendingTime	20130618-11:14:00.000	报文发送时间
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的
50			SenderSubID	XXX	

56			TargetCompID	XXX	详细说明
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
1021			MDBookType	2	行情类型，必传 2-市场深度行情
1173			MDSubBookType	123	行情类型，必传 123-做市报价
263			SubscriptionRequestType	1	订阅标识，必传 1-订阅 2-取消订阅
262			MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID，必传
InstrmtMDReqGrp					
146			NoRelatedSym	1	该场景固定值为 1
→	55		Symbol	-	必须域填写“-”
→	10176		MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
→	167		SecurityType	TB	债券类型，必传
StandardTrailer					
10			Checksum	050	

3.7.3 ListMarketDataAck (U100)

ListMarketDataAck报文用于接收订阅、取消订阅市场深度行情反馈信息。

3.7.3.1 IMIX 报文示例

表20 ListMarketDataAck IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	固定值，报文版本号
9			BodyLength	9	报文长度
35			MsgType	U100	ListMarketDataAck
34			MsgSeqNum	34	报文序列号
52			SendingTime	20130618-11:14:00.000	报文发送时间
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
1021			MDBookType	2	行情类型，必传 2-市场深度行情
1173			MDSubBookType	123	行情类型，必传 123-做市报价

263			SubscriptionRequest Type	1	订阅标识, 必传 1-订阅 2-取消订阅
262			MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID, 必传
10686			SubscriptionStatus	1	订阅状态, 必传 0-成功 1-失败
11251			ApplErrorCode	XXX	错误代码 当订阅状态取值失败时传输
11261			ApplErrorDesc	XXX	错误原因 当订阅状态取值失败时传输
InstrmtMDReqGrp					
146			NoRelatedSym	1	该场景固定取值为 1
→	Instrument				
→	55		Symbol	-	组件必须域, 取值“-”
→	10176		MarketIndicator	4	市场, 必传 4-现券买卖
→	167		SecurityType	TB	债券类型, 必传
StandardTrailer					
10			Checksum	050	

3.7.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W)

MarketDataSnapshotFullRefresh报文用于接收市场深度行情。

空档位行情, 则该方向上只传输清算速度 (63)、档位值 (1023=1), 其余字段均不传输;

非空档位行情, 则按照实际档位数进行传输, 每一档下面的买入/卖出字段均为必传字段。

3.7.4.1 IMIX 报文示例

表21 MarketDataSnapshotFullRefresh 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	50	报文体长度
35				MsgType	W	MarketDataSnapshotFullRefresh
34				MsgSeqNum	99	消息序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	消息发送时间
49				SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明
50				SenderSubID	XXX	
56				TargetCompID	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
1021				MDBookType	2	行情类型，必传

						2-市场深度行情
1173				MDSubBookType	123	行情类型, 必传 123-做市报价
10176				MarketIndicator	4	市场, 必传 4-现券买卖
262				MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID, 选传 保留字段
167				SecurityType	TB	债券类型, 必传
48				SecurityID	XXX	债券代码, 必传
55				Symbol	XXX	债券名称, 必传
264				MarketDepth	10	档位信息, 必传 固定取值 10
MDFullGrp						
268				NoMDEntries	10	重复组次数 作为各档行情标识头信息; 若实际买入只有一档, 卖出只有三档, 则档位信息 (264 号域) 仍填写 10, 但买入只填一档的数据, 卖出只填三档的数据; 若债券的某个方向行情被点空了或者被全部撤销, 档位信息还在, 但对应的方向不填数据, 若两个方向行情均被点空了或者被全部撤销, 档位信息还在, 但两个方向均不填数据, 此时, 档位 (1023 号域取值 1) 和清算速度 (63 号域) 传输, 其余 268 组件的域不传输。 若某档位行情不为空, 则该档位的行情字段除汇率、到期收益率字段为条件必传外, 其余字段均必传。
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	1	第一档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传 107-做市报价
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传

→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结 算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数, 该场景取 值固定为 1 报价方机构组件, 选传
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID 选传
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	2	第二档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传 107-做市报价
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 必传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率

						选传，若债券币种和结算币种不一致，则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 报价方机构组件，选传 该场景取值固定为 1
→	→	448		PartyID	–	组件必须域，取值 “–”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	3	第三档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别，选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号，选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间，选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价，选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率，选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价，选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额，选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型，选传
→	63			SettlType	1	清算速度，必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日，选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式，选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种，选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传，若债券币种和结算币种不一致，则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数，该场景取值固定为 1 报价方机构组件，选传
→	→	448		PartyID	–	组件必须域，取值 “–”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	0	0-BID

→	1023			MDPriceLevel	4	第四档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传 107-做市报价
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结 算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数, 该场景取 值固定为 1 报价方机构组件, 选传
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	5	第五档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传

→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 报价方机构组件, 选传 该场景取值固定为 1
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	1	第一档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 报价方机构组件, 选传 该场景取值固定为 1
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码

→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	2	第二档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结 算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数, 该场景取 值固定为 1 报价方机构组件, 选传
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	3	第三档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传

→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 报价方机构组件, 选传 该场景取值固定为 1
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	4	第四档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 报价方机构组件, 选传
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	

→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	5	第五档
→	1070			MDQuoteType	107	报价类别, 选传
→	299			QuoteEntryID	XXX	报价编号, 选传
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间, 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	3.3500	
→	270			MDEntryPx	100	全价, 选传
→	271			MDEntrySize	10002	券面总额, 选传
→	11143			ClearingMethod	6	清算类型, 选传
→	63			SettlType	1	清算速度, 必传
→	64			SettlDate	20160125	结算日, 选传
→	919			DeliveryType	0	结算方式, 选传
→	120			SettlCurrency	USD	结算币种, 选传
→	155			SettlCurrFxRate	1.121245	汇率 选传, 若债券币种和结 算币种不一致, 则必传
→	453			NoPartyIDs	1	重复组个数 该场景取值固定为 1 报价方机构组件, 选传
→	→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数 该场景取值固定为 2
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	→	523	PartySubID	XXXX	
→	→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
StandardTrailer						
10				Checksum	050	

3.8 指示性报价市场深度行情订阅

3.8.1 业务要素

表22 指示性报价市场深度行情业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
行情类型	1021 MDBookType	枚举值: 2-市场深度行情	1021 和 1173 组合表示行情 类型是指示性报价市场深度 行情
	1173 MDSubBookType	124-指示性报价	

市场	10176 MarketIndicator	枚举值: 4-现券买卖	
订阅标识	263 SubscriptionRequestType	枚举值: 1-订阅 2-取消订阅	
债券类型	167SecurityType	枚举值: TB-国债 PFB-政策性金融债 CBB-央行票据 GBAB-政府支持机构债券 CP-短期融资券 MTN-中期票据 CORP-企业债 CD-同业存单 SCP-超短期融资券 ABS-资产支持证券 Other-其它	
债券代码	48 SecurityID	字符串 例如: 170001	
订阅请求 ID	262 MDReqID	例如: MDAAAABBBB00000001	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则”章节的详细说明。
订阅状态	10686 SubscriptionStatus	枚举值: 0-成功 1-失败	
错误代码	11251 ApplErrorCode	字符串	
错误原因	11261 ApplErrorDesc	文本	
清算速度	63 SettlType	枚举值: 2-T+1	
档位信息	264 MarketDepth	取值固定为 5	
	1023 MDPriceLevel	1 表示第一档; 2 表示第二档; 3 表示第三档; 4 表示第四档; 5 表示第五档;	作为各档行情标识头信息, 若实际买入只有一档, 卖出 只有三档, 则档位信息 (264 号域) 仍填写 5, 但实际买 入只填一档的数据, 卖出只 填三档的数据。
买入/卖出方向	269 MDEntryType	枚举值: 0-BID 1-OFFER	

净价	31 LastPx	单位:元, 精度: 4 例如:100000.1234	
到期收益率	235 YieldType 取值 MATURITY 时, 236 Yield 取值为到期收益率	单位: %, 精度: 4 例如: 3.3500	
业务发生时间	272 MDEntryDate	格式为: YYYYMMDD	报价更新时间
	273 MDEntryTime	格式为: HH:MM:SS.SSS	
做市方交易账户 21 位代码	448 PartyID		
	452PartyRole	枚举值: 101-发送方	

3.8.2 MarketDataRequest (V)

MarketDataRequest报文用于订阅、取消订阅市场深度行情。

3.8.2.1 IMIX 报文示例

表23 MarketDataRequest IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX.2.0	固定值，报文版本号
9		BodyLength	9	报文长度
35		MsgType	V	MarketDataRequest
34		MsgSeqNum	99	报文序列号
52		SendingTime	20130618-11:14:00.000	报文发送时间
49		SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》 的“通用规则”章节的详 细说明
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
1021		MDBookType	2	行情类型 2-市场深度行情 必传
1173		MDSubBookType	124	行情类型 124-指示性报价 必传
263		SubscriptionRequestType	1	订阅标识 1-订阅 2-取消订阅

				必传
262		MReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID 必传
InstrmtMDReqGrp				
146		NoRelatedSym	1	该场景固定值为 1
→	55	Symbol	—	必须域填写 “—”
→	10176	MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖 必传
→	167	SecurityType	TB	债券类型 必传
StandardTrailer				
10		Checksum	050	

3.8.3 ListMarketDataAck (U100)

ListMarketDataAck报文用于接收订阅、取消订阅市场深度行情反馈信息。

3.8.3.1 IMIX 报文示例

表24 ListMarketDataAck IMIX 报文标准

域号		域名	取值	说明
StandardHeader				
8		BeginString	IMIX.2.0	固定值，报文版本号
9		BodyLength	9	报文长度
35		MsgType	U100	ListMarketDataAck
34		MsgSeqNum	99	报文序列号
52		SendingTime	20130618-11:14:00.000	报文发送时间
49		SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则”章节的详细说明
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
1021		MDBookType	2	行情类型 2-市场深度行情 必传
1173		MDSubBookType	124	行情类型 124-指示性报价 必传
263		SubscriptionRequestType	1	订阅标识 1-订阅 2-取消订阅 必传
262		MReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID 必传

10686		SubscriptionStatus	1	订阅状态，必传 0-成功 1-失败
11251		ApplErrorCode	XXX	错误代码 当订阅状态取值失败时传输
11261		ApplErrorDesc	XXX	错误原因 当订阅状态取值失败时传输
InstrmtMDReqGrp				
146		NoRelatedSym	1	固定值，取 1
→	Instrument			
→	55	Symbol	-	必须域填写“-”
→	10176	MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖 必传
→	167	SecurityType	TB	债券类型 必传
StandardTrailer				
10		Checksum	050	

3.8.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W)

MarketDataSnapshotFullRefresh报文用于接收市场深度行情。

空档位行情，则该方向上只传输清算速度（63）、档位值（1023=1），其余字段均不传输；

非空档位行情，则按照实际档位数进行传输，每一档下面的买入/卖出字段均为必传字段。

3.8.4.1 IMIX 报文示例

表25 MarketDataSnapshotFullRefresh 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	50	报文体长度
35				MsgType	W	MarketDataSnapshotFullRefresh
34				MsgSeqNum	99	报文序列号
52				SendingTime	20070820-12:40:00.000	报文发送时间
49				SenderCompID	XXX	取值规则参考 1.10 章节-IMIX 报文发送方和接收方取值规则
50				SenderSubID	XXX	
56				TargetCompID	XXX	
57				TargetSubID	XXX	
MessageBody						
1021				MDBookType	2	行情类型 2-市场深度行情 必传

1173				MDSUBBookType	124	行情类型 124-指示性报价 必传
10176				MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖 必传
167				SecurityType	TB	债券类型 必传
48				SecurityID	XXX	债券代码 必传
264				MarketDepth	5	档位信息, 必传 固定取值 5
MDFullGrp						
268				NoMDEntries	10	重复组次数, 取值以实际消息传输为准
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	1	第一档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1. 2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12. 123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	2	第二档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1. 2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12. 123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	3	第三档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1. 2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更

→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	新时间), 选传
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	4	第四档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新 新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	0	0-BID
→	1023			MDPriceLevel	5	第五档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新 新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	1	第一档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新 新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	2	第二档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	

→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	3	第三档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	4	第四档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
→	269			MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023			MDPriceLevel	5	第五档
→	63			SettlType	2	清算速度, 必传
→	31			LastPx	21	净价, 选传
→	235			YieldType	MATURITY	到期收益率, 选传
→	236			Yield	1.2312	
→	272			MDEntryDate	20160514	业务发生时间(报价更新时间), 选传
→	273			MDEntryTime	10:10:12.123	
→	453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	→	448		PartyID	XXX	交易账户 21 位代码
→	→	452		PartyRole	101	101-做市方
StandardTrailer						
10				Checksum	050	

4 快速撤单

若快速撤单成功，则逐条反馈Quote (S) 报价撤销状态更新消息；
若快速撤单失败，则反馈BusinessMessageReject (j) 失败反馈消息。

4.1 业务要素

表26 快速撤单业务要素

字段	IMIX 域	取值说明	备注
客户参考编号	11C10rdID	字符串 例如： ODAAAABBBB12345678	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
市场	10176MarketIndicator	枚举值： 4-现券买卖	
交易方式	10317TradeMethod	枚举值： 5-点击成交	
报价类别	537QuoteType	枚举值： 117-指示性报价	
撤单机构交易账户 21 位代码	448PartyID 452 PartyRole	21 位代码 121-撤单机构	1、如果为主机构撤销报价，则填写主交易账户 21 位代码。 2、如果为投资管理人管理的非法人产品撤销报价，或者为结算代理人代理交易的境外投资人撤销报价，则交易账户 21 位代码。
撤单机构交易员 ID	803PartySubIDType 523PartySubID	枚举值： 2-交易员 ID 文本	必传，撤单机构（包括投资管理人或结算代理人）的交易员 ID

4.2 QuickCancel (U20)

QuickCancel报文用于快速撤销指定交易员发送的报价。

4.2.1 IMIX 报文示例

表27 QuickCancel IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
StandardHeader					
8			BeginString	IMIX.2.0	报文版本号
9			BodyLength	1	报文体长度
35			MsgType	U20	报文类型
34			MsgSeqNum	24	报文序列号
52			SendingTime	20110520-12:40:00.000	报文发送时间
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	

MessageBody					
11			ClOrdID	XXXX	客户参考编号，必传
10176			MarketIndicator	4	市场，必传
10317			TradeMethod	5	交易方式，必传
537			QuoteType	107	报价类别，必传
453			NoPartyIDs	1	固定取值 1
→	448		PartyID	XXXX	交易账户 21 位代码，必传
→	452		PartyRole	121	121-撤单机构
→	802		NoPartySubIDs	1	固定取值 1
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	交易员 ID，必传
StandardTrailer					
10			Checksum	XXX	

参 考 文 献

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