

# 新平台本币交易接口开发指南 (现券市场)

---

CFETS/K1775—2019

## 第六卷：匿名点击交易流程

(2.0.0)

目 次

前言 ..... II

引 言 ..... III

修改历史 ..... IV

1 文档使用说明 ..... 1

1.1 文档用途 ..... 1

1.2 文档结构 ..... 1

2 匿名点击交易流程 ..... 3

2.1 整体流程 ..... 3

2.2 交易 ..... 4

2.2.1 场景一：订单管理 ..... 4

2.3 行情 ..... 6

2.3.1 场景一：市场行情订阅及数据推送 ..... 6

3 现券买卖 ..... 8

3.1 订单 ..... 8

3.1.1 业务要素 ..... 8

3.1.2 NewOrderSingle (D) ..... 11

3.1.2.1 IMIX 报文示例 ..... 11

3.1.3 OrderCancelRequest (F) ..... 13

3.1.3.1 IMIX 报文示例 ..... 13

3.1.4 OrderCancelReject (9) ..... 14

3.1.4.1 IMIX 报文示例 ..... 14

3.1.5 ExecutionReport (8) ..... 14

3.1.5.1 IMIX 报文示例 ..... 14

3.1.5.2 使用场景 ..... 16

3.2 行情 ..... 18

3.2.1 业务要素 ..... 18

3.2.2 MarketDataRequest (V) ..... 20

3.2.2.1 IMIX 报文示例 ..... 20

3.2.3 ListMarketDataAck (U100) ..... 21

3.2.3.1 IMIX 报文示例 ..... 22

3.2.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W) ..... 23

3.2.4.1 IMIX 报文示例 ..... 23

3.2.4.2 使用场景 ..... 24

参考文献 ..... 26

图 1 交易接口流程图 ..... 3

图 2 行情接口流程图 ..... 4

图 3 订单场景一时序图 ..... 5

图 4 行情场景一时序图 ..... 7

表 1 章节列表 ..... 1

表 2 订单场景一 IMIX 报文交互 ..... 5

表 3 行情场景一 IMIX 报文交互 ..... 7

表 4 订单业务要素 ..... 8

表 5 NewOrderSingle IMIX 报文标准 ..... 11

表 6 OrderCancelRequest IMIX 报文标准 ..... 13

表 7 ExecutionReport IMIX 报文标准 ..... 14

表 8 ExecutionReport IMIX 报文标准 ..... 14

表 9 ExecutionReport 报文使用场景 ..... 16

表 10 行情业务要素 ..... 18

表 11 MarketDataRequest IMIX 报文标准 ..... 20

表 12 ListMarketDataAck IMIX 报文标准 ..... 22

表 13 MarketDataSnapshotFullRefresh IMIX 报文标准 ..... 23

表 14 MarketDataSnapshotFullRefresh 使用场景..... 24

## 前 言

本文件依据新平台本币交易接口业务需求起草。

本文件由中国外汇交易中心归口。

本文件提出单位：中国外汇交易中心。

本文件负责起草单位：中国外汇交易中心。

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

## 引 言

随着我国金融改革不断深化，银行间市场信息化也在不断提高，金融标准逐步渗透到市场活动的各个层面。银行间市场标准工作组组长单位中国外汇交易中心积极贯彻总行战略部署，持续推进银行间市场标准化建设，牵头编制了JR/T 0065—2011《银行间市场基础数据元》、JR/T 0066—2011《银行间市场业务数据交换协议》、JR/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
冉杨鋆		0.0.1		2018/3/30	1. 创建文档。
李云毅、 赵晓韵、 江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.0	1.138.0-2.8.3	2018/4/9	1. 正式发布，升级版本号。
江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.1	1.139.3-2.10.0	2018/8/10	1. 删除字段“订单有效时间类型”。 2. 3.1.1 现券买卖业务要素章节，字段“用户参考数据 1-6”增加说明：长度不超过 20 个字节；字段“交易金额”精度改为：2 位。 3. 3.1.4.2 使用场景（ExecutionReport 报文）章节，字段“对手方机构 21 位码和对手方交易员 ID”改为“当订单状态取值有效（部分成交）和成交时，必传”。 4. 字段“客户参考编号”改为“有则必传”，涉及章节 3.1.4.2 使用场景表“ExecutionReport 报文使用场景”中“订单提交反馈、订单撤销反馈”列。字段“原客户参考编号”改为“如果是单笔订单撤销（撤销标识取值 0）有则必传，撤销标识其他值时不传输。”涉及章节 3.1.30orderCancelRequest（F）。字段“原客户参考编号”改为“有则必传”涉及章节 3.1.4.2 使用场景表“ExecutionReport 报文使用场景”中“订单撤销反馈”列。 5. 3.1.4.2 使用场景表“ExecutionReport 报文使用场景”中“订单提交反馈”列修改当订单提交失败反馈时传输字段为：市场、客户参考编号、操作状态、错误代码、错误原因、业务发生时间；“订单撤销反馈”列修改当订单撤销失败反馈时传输字段为：市场、客户参考编号、原客户参考编号、订单编号、操作状态、错误代码、错误原因、业务发生时间。 6. 通篇将“机构 21 位码”改为“交易账户 21 位码”。
江云南	冉杨鋆 卜天奇	1.0.2	1.139.9-2.10.2	2018/10/23	1. 其他卷有更新，同步升级版本号。
江云南	冉杨鋆 邓可欣	1.0.3	1.140.3-2.10.3	2018/11/24	1. 其他卷有更新，同步升级版本号。

	杨帆				
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	1.0.4	1.140.3-2.10.3	2018/12/19	1. 其他卷有更新，同步升级版本号。
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	1.0.5	1.140.3-2.10.3	2019/01/02	1. 其他卷有更新，同步升级版本号。
江云南	唐军敏 冉杨璠 杨帆	2.0.0	1.140.6-2.10.4	2019/01/09	<ol style="list-style-type: none"> <li>3.1.2 NewOrderSingle (D) 新增订单章节，删除字段“本方交易账户 21 位码”；增加字段“上市前交易标识、场次日期、报价来源、债券类型名称、待偿期、债券名称、清算类型、机构 6 位码、交易账户中文简称、发行人机构代码”。以上字段改动同时涉及 3.1.1 业务要素章节更新。</li> <li>3.1.3 OrderCancelRequest (F) 撤销订单章节，删除字段“撤销标识、原客户参考编号、本方交易账户 21 位码、本方交易员 ID”；增加字段“报价方式、用户参考数据 1~6”。以上字段改动同时涉及 3.1.1 业务要素章节更新。</li> <li>订单提交反馈和订单撤销反馈消息传输字段改成：市场、客户参考编号、订单编号、操作状态、错误代码、错误原因、用户参考数据 1~6。</li> <li>3.1.5 ExecutionReport (8) 章节，订单状态变化推送消息，删除字段“交易方式、订单状态描述、操作类型、用户参考数据 1~6、全价、应计利息、交易金额、应计利息总额、结算金额、结算币种、结算方式、结算日”；增加字段“报价来源、订单类型、成交价格、成交量”；字段“本方/对手方交易账户 21 位码”改成“本方/对手方交易账户 6 位码”。以上字段改动同时涉及 3.1.1 业务要素章节更新。</li> <li>3.2.2 MarketDataRequest (V) 行情订阅章节，增加字段“债券代码、报价方式、清算速度、本方机构 6 位码、API 用户 ID”；删除字段“债券类型、本方交易账户 21 位码”；行情订阅可以按照多只债券进行订阅。</li> <li>3.2.3 ListMarketDataAck (U100) 行情订阅反馈章节，增加字段“债券代码”；删除字段“债券类型”。</li> <li>3.2.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W) 行情推送章节，字段“行情日期行情时间”使用域改成 60TransactTime；字段“报</li> </ol>

					买量报卖量”使用域改成 271MDEntrySize。 8. 订 单 撤 销 失 败 反 馈 消 息 改 用 OrderCancelReject (9) 消息类型传输。
--	--	--	--	--	--



## 第 6 卷-匿名点击交易流程

### 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《第六卷：匿名点击交易流程》，对新平台本币交易接口的匿名点击交易流程进行介绍，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
<b>第一卷：业务介绍</b>	
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》
<b>第二卷：通用功能</b>	
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
<b>第三卷：对话报价交易流程</b>	
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
<b>第四卷：点击成交与指示性报价交易流程</b>	
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
<b>第五卷：请求报价交易流程</b>	
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
<b>第六卷：匿名点击交易流程</b>	
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
<b>附录一：本币参考数据接口会员端 XML 文档</b>	
<b>附录二：本币成员端数据下载 IMIX 协议开发指引</b>	

2 匿名点击交易流程

2.1 整体流程

匿名点击方式是指交易双方提交匿名的限价订单，系统根据授信情况按照价格优先、时间优先原则自动匹配成交的交易方式。未匹配成交的限价订单可供参与机构点击成交。匿名点击流程包括交易双方提交订单、匹配成交两个环节。

匿名点击交易流程分授信、交易、行情三部分，其中交易接口目前支持交易和行情。交易相关流程如下图：

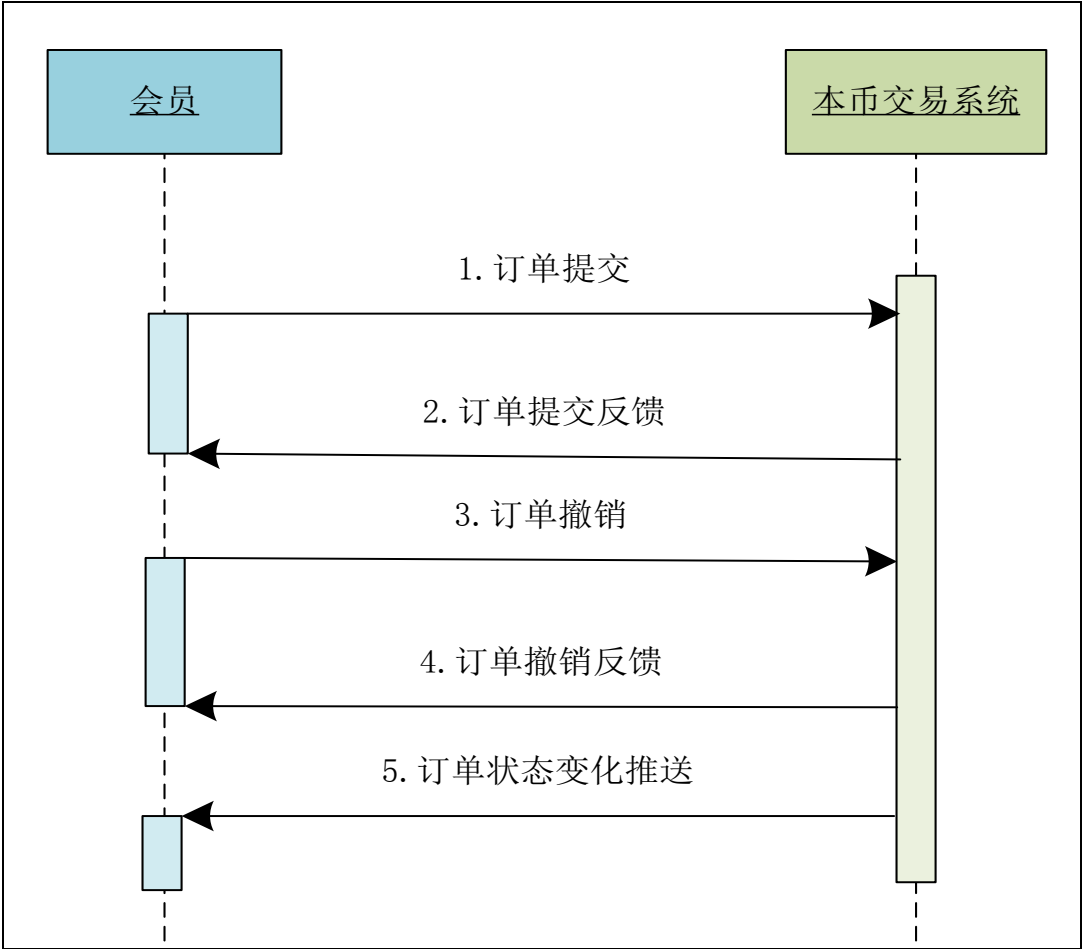


图1 交易接口流程图

行情相关流程如下图：

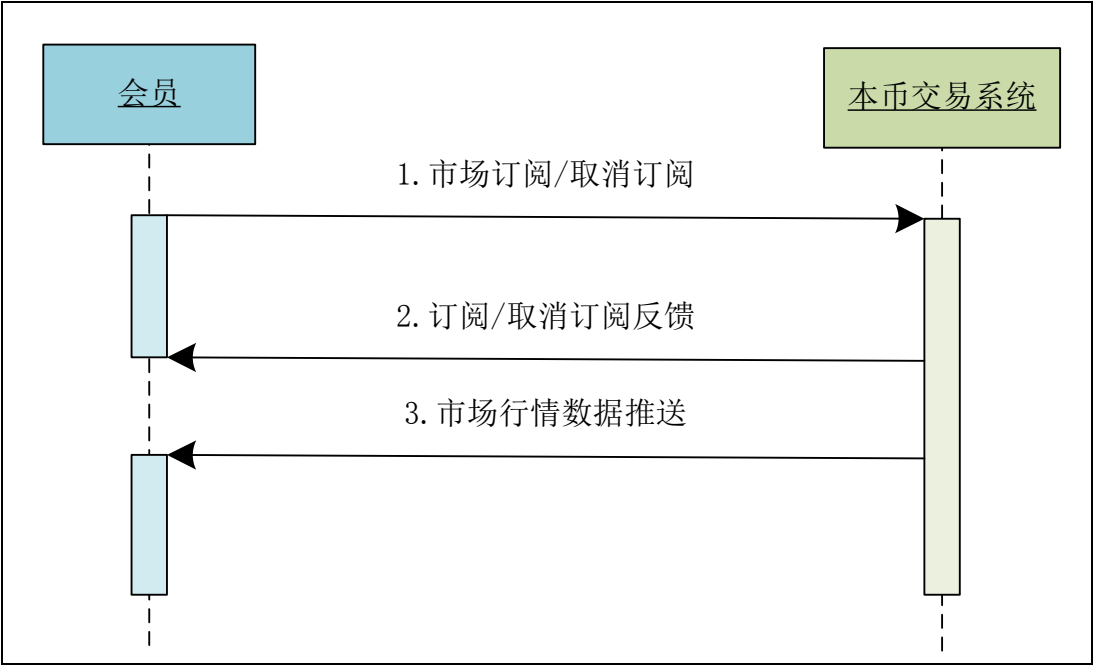


图2 行情接口流程图

2.2 交易

2.2.1 场景一：订单管理

用户通过订单接口提交订单，提交的订单直接以有效订单的状态进入撮合队列。系统向会员发送订单提交反馈。

会员机构有 API 交易权限的交易员可以通过接口，对自己通过 API 提交的订单进行撤销，撤销后的订单不可以再进行任何操作。现券买卖集中报价结束时间开始时不允许进行订单撤销。系统向会员发送订单撤销反馈。

当一个通过 API 提交的订单状态发生变化时，系统通过接口实时推送该订单的状态变更信息。

业务时序图如下：

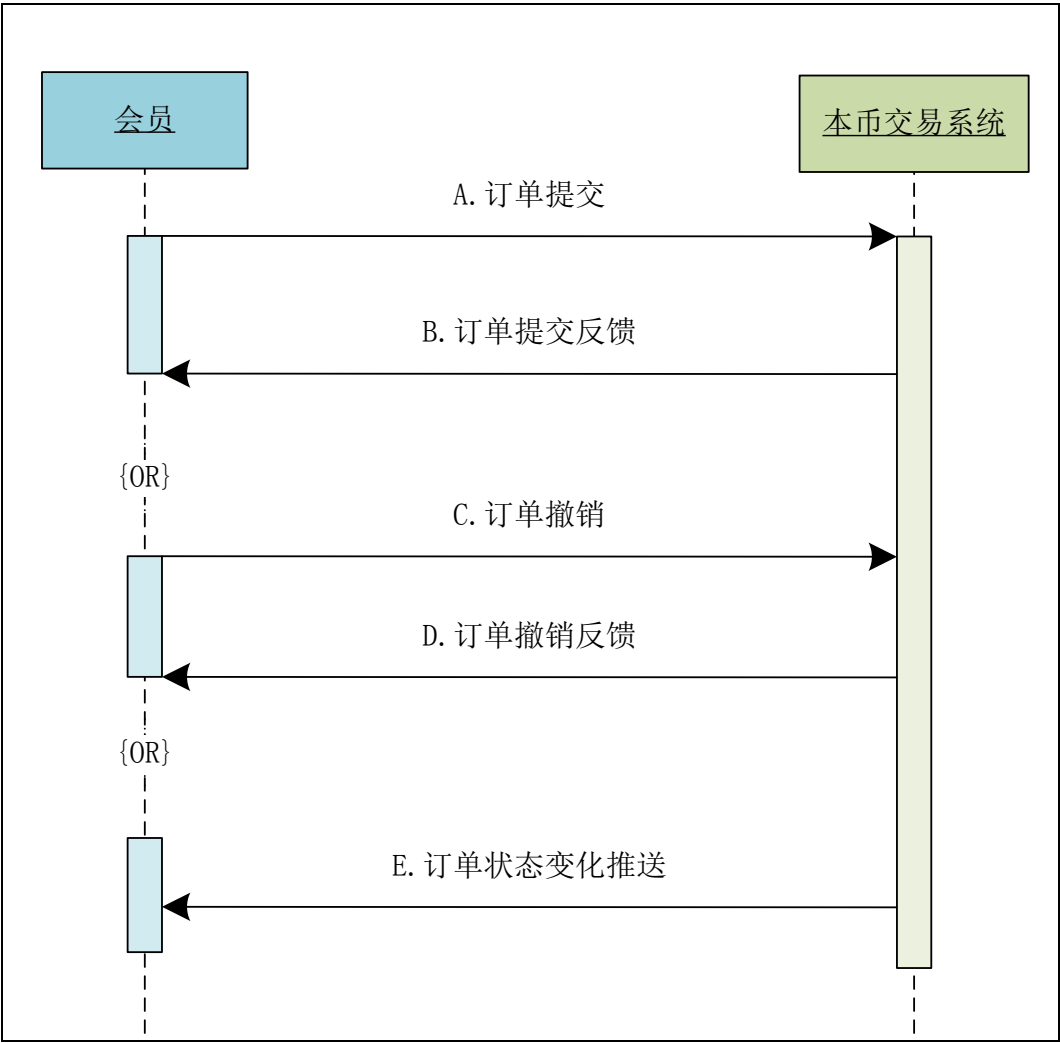


图3 订单场景一时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表2 订单场景一 IMIX 报文交互

IMIX 2.0				
(A)订单提交	会员	→	<b>D - NewOrderSingle</b> OrdType(40)=2(限价订单)/b(FAK) ClOrdID(11)=①	本币交易系统
(B)订单提交反馈		←	<b>8 - ExecutionReport</b> ExecAckStatus(1036)=1(成功)/2(失败) ClOrdID(11)=① OrderID(37)=②	
(C)订单撤销		→	<b>F - OrderCancelRequest</b> ClOrdID(11)=③ OrderID(37)=②	
(D)订单撤销成功反馈		←	<b>8 - ExecutionReport</b> ExecAckStatus(1036)=1(成功) ClOrdID(11)=③	

IMIX 2.0			
			OrderID(37)=②
(D)订单撤销失败反馈	←	<b>9 - OrderCancelReject</b> ClOrdID (11)=③ OrderID(37)=②	
(E)订单状态变化推送	←	<b>8 - ExecutionReport</b> OrdStatus(39)=0(有效)/2(成交)/4(撤销)/I(冻结) OrderID(37)=②	

2.3 行情

2.3.1 场景一：市场行情订阅及数据推送

会员向系统发送市场行情订阅/取消订阅请求，然后系统向会员发送行情订阅反馈消息。  
在当前登录的API用户已经订阅行情的基础上，系统根据用户订阅的行情类型对当前市场行情进行推送。

业务时序图如下：

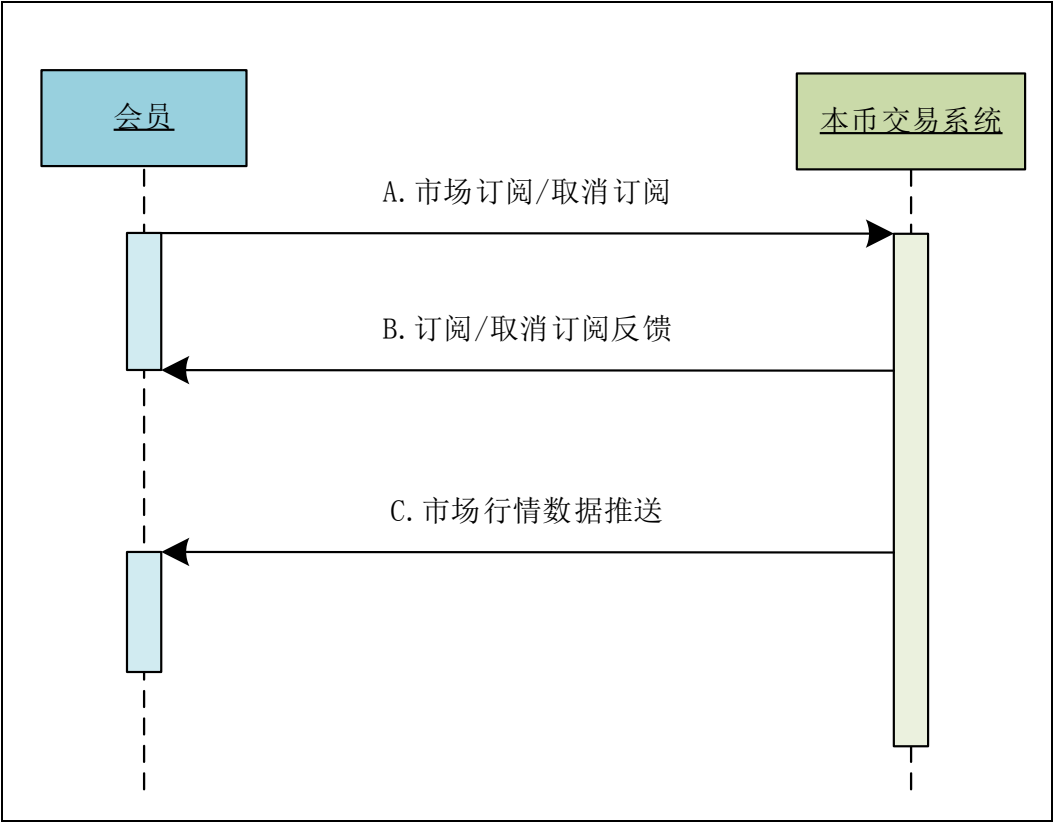


图4 行情场景一时序图

业务流程中的IMIX报文交互如下：

表3 行情场景一 IMIX 报文交互

IMIX 2.0
----------

IMIX 2.0				
(A)市场订阅/取消订阅	会员	→	<b>V - MarketDataRequest</b> SubscriptionRequestType(263)=1(订阅)/2(取消订阅) MDBookType(1021)=1(最优行情)/2(市场深度行情)/107(集中匹配行情) MDReqID(262)=①	本币交易系统
(B)订阅/取消订阅反馈		←	<b>U100 - ListMarketDataAck</b> SubscriptionRequestType(263)=1(订阅)/2(取消订阅) MDBookType(1021)= 1(最优行情)/2(市场深度行情) /107(集中匹配行情) SubscriptionStatus(10686)=0(成功)/1(失败) MDReqID(262)=①	
(C)市场行情数据推送		←	<b>W - MarketDataSnapshotFullRefresh</b> MDBookType(1021)=1(最优行情)/2(市场深度行情) /107(集中匹配行情)	

### 3 现券买卖

本章节对现券买卖市场的匿名点击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 订单

##### 3.1.1 业务要素

表4 订单业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
市场	10176MarketIndicator	枚举值： 4-现券买卖	
上市前交易标识	11889 PreMarketBondIndicator	枚举值： Y-YES N-NO	
报价来源	10687 DataSourceString	枚举值： 0-客户端 2-API	
场次日期	10039 DateConfirmed	格式为：YYYYMMDD	
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 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	
发行人机构代码	452 PartyRole	枚举值： 206-发行人	债券的发行人机构 6 位码
	803 PartySubIDType	枚举值： 135-机构代码	
	523 PartySubID	文本	
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	
订单类型	40 OrdType	枚举值： 2-限价订单 b-FAK（点击成交）	
订单状态	39 OrdStatus	枚举值： 0-有效 2-成交 4-撤销 I-冻结	
客户参考编号	11 ClOrdID	字符串 例如：ODAAAABBBB00000001	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
订单编号	37 OrderID	文本	
操作状态	1036 ExecAckStatus	枚举值： 1-成功 2-失败	
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	
债券代码	48 SecurityID	字符串 例如：170001	
债券名称	55 Symbol	文本	

交易方向	54 Side	枚举值: 1-买入 2-卖出	
报价方式	574 MatchType	枚举值: 9-连续匹配 10-集中匹配	
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
到期收益率 (%)	235YieldType	枚举值: MATURITY-到期收益率	
	236 Yield	精度: 4 位	
行权收益率 (%)	233 StipulationType	枚举值: StrikeYield-行权收益率	
	234 StipulationValue	精度: 4 位	
净价 (元)	44 Price	精度: 4 位	
券面总额 (元)	38 OrderQty	精度: 0 位	
剩余总量 (元)	151 LeavesQty	精度: 0 位	
清算类型	11143 ClearingMethod	枚举值: 6-净额清算 (保留枚举值, 暂不支持) 13-全额清算	
清算速度	63 SettlType	枚举值: 1-T+0 2-T+1	
成交日期	75 TradeDate	格式: YYYYMMDD	
成交时间	10318TradeTime	格式: HH:MM:SS.sss	
成交编号	17 ExecID	文本	
成交价格 (元)	31 LastPx	精度: 4 位	
成交量 (元)	32 LastQty	精度: 0 位	
本方标识	452PartyRole	枚举值: 1-本方	
本方机构 6 位码	803 PartySubIDType	枚举值: 135-机构 6 位码	
	523 PartySubID	文本	
本方交易账户 6 位码	803 PartySubIDType	枚举值: 266-交易账户 6 位码	
	523 PartySubID	文本	
本方交易账户中	803PartySubIDType	枚举值:	

文简称		266-交易账户中文简称	
	523PartySubID	文本	
本方交易员 ID	803 PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523 PartySubID	文本	
对手方标识	452PartyRole	枚举值： 17-对手方	
对手方交易账户 6 位码	803 PartySubIDType	枚举值： 266-交易账户 6 位码	
	523 PartySubID	文本	
对手方交易员 ID	803PartySubIDType	枚举值： 2-交易员 ID	
	523 PartySubID	文本	

### 3.1.2 NewOrderSingle (D)

NewOrderSingle报文用于提交订单。

#### 3.1.2.1 IMIX 报文示例

表5 NewOrderSingle 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	23	报文体长度
35			MsgType	D	报文类型
34			MsgSeqNum	23	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
11889			PreMarketBondIndicator	N	上市前交易标识，必传 Y-YES N-NO
10039			DateConfirmed	20181203	场次日期，必传
10687			DataSourceString	2	报价来源，必传 2-API
107			SecurityDesc	国债	债券类型名称，必传
11989			TermToMaturityString	100D	待偿期

40			OrdType	2	订单类型，必传 2-限价订单 b-FAK（点击成交）
11			ClOrdID	ODAAAABBBB00000001	客户参考编号，必传
48			SecurityID	XXX	债券代码，必传
55			Symbol	XXX	债券名称，必传
54			Side	1	交易方向，必传 1-买入 2-卖出
574			MatchType	9	报价方式，必传 9-连续匹配 10-集中匹配
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
44			Price	2.0012	净价（元），必传
38			OrderQty	5000	券面总额（元），必传
11143			ClearingMethod	13	清算类型，必传 6-净额清算（保留枚举值， 暂不支持） 13-全额清算
63			SettlType	1	清算速度，必传 1-T+0 2-T+1
235			YieldType	MATURITY	到期收益率（%），选传
236			Yield	0.2311	
232			NoStipulations	1	重复组个数
→	233		StipulationType	StrikeYield	行权收益率（%），仅含权债 选传，其他不传
→	234		StipulationValue	0.2344	
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	1	1-本方
→	802		NoPartySubIDs	4	重复组个数，固定取值 4。
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码，必传
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码，必传
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	267	267-交易账户中文简称，必

					传
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID, 必传
→	448		PartyID	-	组件必须域, 取值“-”
→	452		PartyRole	206	<b>206-发行人</b>
→	802		NoPartySubIDs	1	该场景取固定为 1
→	→	523	PartySubID	XXXX	发行人机构代码
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码
<b>StandardTrailer</b>					
10			Checksum	50	校验和

### 3.1.3 OrderCancelRequest (F)

OrderCancelRequest报文用于传输订单撤销。

#### 3.1.3.1 IMIX 报文示例

表6 OrderCancelRequest 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	9	报文体长度
35			MsgType	F	报文类型
34			MsgSeqNum	23	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场, 必传 4-现券买卖
11			ClOrdID	ODAAAABBBB00000002	客户参考编号, 必传
37			OrderID	XXX	订单编号, 必传
574			MatchType	9	报价方式, 必传 9-连续匹配 10-集中匹配
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
StandardTrailer					

10			Checksum	50	校验和
----	--	--	----------	----	-----

### 3.1.4 OrderCancelReject (9)

OrderCancelReject报文用于传输订单撤销失败反馈消息。

#### 3.1.4.1 IMIX 报文示例

表7 ExecutionReport 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	12	报文体长度
35			MsgType	9	报文类型
34			MsgSeqNum	23	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间 格式:YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场，必传 4-现券买卖
11			ClOrdID	ODAAAABBBB00000002	客户参考编号，必传
37			OrderID	XXX	订单编号，必传
11251			ApplErrorCode	XXX	错误代码，必传
11261			ApplErrorDesc	XXX	错误原因，必传
60			TransactTime	20130618-11:14:00.123	业务发生时间，必传
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
StandardTrailer					
10			Checksum	50	校验和

### 3.1.5 ExecutionReport (8)

ExecutionReport报文用于传输订单提交反馈、订单撤销成功反馈、订单状态变化推送。

#### 3.1.5.1 IMIX 报文示例

表8 ExecutionReport IMIX 报文标准

域号			域名	取值	说明
<b>StandardHeader</b>					

8			BeginString	IMIX. 2. 0	报文版本号
9			BodyLength	9	报文体长度
35			MsgType	8	报文类型
34			MsgSeqNum	23	报文序列号
52			SendingTime	20070820-12:40:00.000	发送时间 格式： YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
10176			MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖
10687			DataSourceString	2	报价来源 0-客户端 2-API
40			OrdType	2	订单类型 2-限价订单 b-FAK（点击成交）
39			OrdStatus	4	订单状态 0-有效 2-成交 4-撤销 I-冻结
11			ClOrdID	ODAAAABBBB00000001	客户参考编号
37			OrderID	XXX	订单编号
1036			ExecAckStatus	1	操作状态 1-成功 2-失败
11251			ApplErrorCode	XXX	错误代码
11261			ApplErrorDesc	XXX	错误原因
60			TransactTime	20130618-11:14:00.123	业务发生时间
48			SecurityID	XXX	债券代码
54			Side	1	交易方向
574			MatchType	9	报价方式
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
44			Price	100.0011	净价（元）
38			OrderQty	10000	券面总额（元）

151			LeavesQty	2000	剩余总量（元）
11143			ClearingMethod	13	清算类型 6-净额清算（保留枚举值，暂不支持） 13-全额清算
63			SettlType	1	清算速度 1-T+0 2-T+1
75			TradeDate	20170302	成交日期
10318			TradeTime	11:14:00.123	成交时间
17			ExecID	XXX	成交编号
31			LastPx	99.0001	成交价格（元）
32			LastQty	5000	成交量（元）
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	1	1-本方机构
→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
→	448		PartyID	-	组件必须域，取值“-”
→	452		PartyRole	17	17-对手方机构
→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	266	266-交易账户 6 位码
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	2	2-交易员 ID
<b>StandardTrailer</b>					
10			Checksum	50	校验和

### 3.1.5.2 使用场景

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

表9 ExecutionReport 报文使用场景

业务字段	IMIX 域	订单提交反馈	订单撤销成功反馈	订单状态变化推送
市场	10176 MarketIndicator	必传	必传	必传
报价来源	10687 DataSourceString	-	-	必传
订单类型	40 OrdType	-	-	必传
订单状态	39 OrdStatus	-	-	必传
客户参考编号	11 ClOrdID	必传	必传	有则必传



业务字段	IMIX 域	订单提交反馈	订单撤销成功反馈	订单状态变化推送
订单编号	37 OrderID	订单提交成功时传输	必传	必传
操作状态	1036 ExecAckStatus	必传	必传	-
错误代码	11251 ApplErrorCode	订单提交失败时传输	-	-
错误原因	11261 ApplErrorDesc	订单提交失败时传输	-	-
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	-	-	必传
交易方向	54 Side	-	-	必传
报价方式	574 MatchType	-	-	必传
用户参考数据 1	11405 UserReference1	有则必传	有则必传	-
用户参考数据 2	11406 UserReference2	有则必传	有则必传	-
用户参考数据 3	11407 UserReference3	有则必传	有则必传	-
用户参考数据 4	11498 UserReference4	有则必传	有则必传	-
用户参考数据 5	11499 UserReference5	有则必传	有则必传	-
用户参考数据 6	11500 UserReference6	有则必传	有则必传	-
净价（元）	44 Price	-	-	必传
券面总额（元）	38 OrderQty	-	-	必传
剩余总量（元）	151 LeavesQty	-	-	必传
清算类型	11143 ClearingMethod	-	-	必传
清算速度	63 SettlType	-	-	必传
成交日期	75 TradeDate	-	-	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
成交时间	10318 TradeTime	-	-	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
成交编号	17 ExecID	-	-	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
成交价格	31 LastPx	-	-	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
成交量（元）	32 LastQty	-	-	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
本方交易账户 6 位码	当 803PartySubIDType=266 时 523PartySubID	-	-	必传
本方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	-	-	必传

业务字段	IMIX 域	订单提交反馈	订单撤销成功反馈	订单状态变化推送
对手方交易账户 6 位码	当 803PartySubIDType=267 时 523PartySubID	—	—	当订单状态取值成交时必传，其他不传。
对手方交易员 ID	当 803PartySubIDType=2 时 523PartySubID	—	—	当订单状态取值成交时必传，其他不传。

### 3.2 行情

#### 3.2.1 业务要素

表10 行情业务要素

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
市场	10176 MarketIndicator	枚举值： 4-现券买卖	
订阅请求 ID	262 MDReqID	字符串 例如： MDAAAABBBB00000001	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
订阅标识	263 SubscriptionRequestType	枚举值： 1-订阅 2-取消订阅	
行情类型	1021 MDBookType	枚举值： 1-最优行情 2-市场深度行情 107-集中匹配行情	
报价方式	574 MatchType	枚举值： 9-连续匹配 10-集中匹配	行情类型取值“最优行情、市场深度行情”传“9-连续匹配”；取值“集中匹配行情”传“10-集中匹配”
债券代码	48 SecurityID	字符串 例如：170001	
债券名称	55 Symbol	文本	
清算速度	63 SettlType	枚举值： 1-T+0 2-T+1	
错误代码	11251 ApplErrorCode	字符串	
错误原因	11261 ApplErrorDesc	文本	
订阅状态	10686 SubscriptionStatus	枚举值： 0-成功 1-失败	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
档位信息	264 MarketDepth	固定取值为 5	
	1023 MDPriceLevel	枚举值： 1-第一档 2-第二档 3-第三档 4-第四档 5-第五档	
业务发生时间	60 TransactTime	格式为：YYMMDD-HH:MM:SS. sss	
买入未匹配量 (元)	269 MDEntryType	枚举值： 0-BID	
	11609 UnMatchQty	精度：0 位	
可成交总量 (元)	269MDEntryType	枚举值： B-成交	
	1020 TradeVolum	精度：0 位	
开盘净价(元)	269MDEntryType	枚举值： 4-开盘价	
	270 MDEntryPx	精度：4 位	
开盘到期(%)	269MDEntryType	枚举值： k-开盘到期	
	270 MDEntryPx	精度：4 位	
卖出未匹配量 (元)	269 MDEntryType	枚举值： 1-OFFER	
	11609 UnMatchQty	精度：0 位	
报买量(元)	269 MDEntryType	枚举值 0-BID	
	1020 TradeVolume	精度：0 位	
报买可成交量 (元)	269 MDEntryType	枚举值： 0-BID	
	271 MDEntrySize	精度：0 位	
报买净价(元)	269 MDEntryType	枚举值： 0-BID	
	270 MDEntryPx	精度：4 位	
报买到期(%)	269 MDEntryType	枚举值： 0-BID	
	235 YieldType	枚举值： MATURITY-到期收益率	
	236Yield	精度：4 位	
报卖量(元)	269 MDEntryType	枚举值： 1-OFFER	
	1020 TradeVolume	精度：0 位	

业务字段	IMIX 域	取值说明	备注
报卖可成交量 (元)	269 MEntryType	枚举值: 1-OFFER	
	271 MEntrySize	精度: 0 位	
报卖净价(元)	269 MEntryType	枚举值: 1-OFFER	
	270 MEntryPx	精度: 4 位	
报卖到期(%)	269 MEntryType	枚举值: 1-OFFER	
	235 YieldType	枚举值: MATURITY-到期收益率	
	236Yield	精度: 4 位	
本方标识	452PartyRole	枚举值: 1-本方	
本方机构 6 位 码	803 PartySubIDType	枚举值: 135-机构 6 位码	
	523 PartySubID	文本	
API 用户 ID	803 PartySubIDType	枚举值: 162-用户 ID	
	523 PartySubID	文本	

### 3.2.2 MarketDataRequest (V)

MarketDataRequest报文用于发送市场行情订阅/取消订阅请求。

#### 3.2.2.1 IMIX 报文示例

表11 MarketDataRequest 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	9	报文长度
35			MsgType	V	报文类型
34			MsgSeqNum	34	报文序列号
52			SendingTime	20170206-11:14:00.000	发送时间 格式: YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49			SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50			SenderSubID	XXX	
56			TargetCompID	XXX	
57			TargetSubID	XXX	
MessageBody					
262			MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID, 必传
263			SubscriptionRequestType	1	订阅标识, 必传 1-订阅 2-取消订阅

1021			MDBookType	2	行情类型，必传 1-最优行情 2-市场深度行情 107-集中匹配行情
146			NoRelatedSym	2	重复组个数，取值以实际传输为准
→	55		Symbol	-	组件必须域，取值“-”
→	48		SecurityID	XXX	债券代码，必传
→	574		MatchType	9	报价方式，必传 9-连续匹配 10-集中匹配 行情类型取值“最优行情、市场深度行情”传“9-连续匹配”； 取值“集中匹配行情”传“10-集中匹配”
→	63		SettlType	1	清算速度，必传
→	10176		MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖，必传
→	55		Symbol	-	组件必须域，取值“-”
→	48		SecurityID	XXX	债券代码，必传
→	574		MatchType	9	报价方式，必传 9-连续匹配 10-集中匹配 行情类型取值“最优行情、市场深度行情”传“9-连续匹配”； 取值“集中匹配行情”传“10-集中匹配”
→	63		SettlType	1	清算速度，必传
→	10176		MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖，必传
453			NoPartyIDs	1	重复组个数 该场景取值固定为 1
→	448		PartyID	-	组件必须域，取值“-”
→	452		PartyRole	1	1-本方
→	802		NoPartySubIDs	2	重复组个数，固定取值 2。
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	135	135-机构 6 位码，必传
→	→	523	PartySubID	XXX	
→	→	803	PartySubIDType	162	162-API 用户 ID，必传
<b>StandardTrailer</b>					
10			Checksum	50	校验和

### 3.2.3 ListMarketDataAck (U100)

ListMarketDataAck报文用于市场行情订阅反馈。

## 3.2.3.1 IMIX 报文示例

表12 ListMarketDataAck 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	9	报文长度
35		MsgType	U100	报文类型
34		MsgSeqNum	34	报文序列号
52		SendingTime	20170206-11:14:00.000	发送时间 格 式 : YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss
49		SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的 “通用规则”章节的详细说明。
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
262		MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID，必传
263		SubscriptionRequestType	1	订阅标识，必传 1-订阅 2-取消订阅
1021		MDBookType	2	行情类型，必传 1-最优行情 2-市场深度行情 107-集中匹配行情
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
146		NoRelatedSym	2	重复组个数 该场景取值以实际传输为准
→	55	Symbol	-	组件必须域，取值“-”
→	48	SecurityID	XXX	债券代码，必传
→	10176	MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖，必传
→	55	Symbol	-	组件必须域，取值“-”
→	48	SecurityID	XXX	债券代码，必传
→	10176	MarketIndicator	4	市场 4-现券买卖，必传
StandardTrailer				
10		Checksum	50	校验和

## 3.2.4 MarketDataSnapshotFullRefresh (W)

MarketDataSnapshotFullRefresh报文用于集中匹配、最优行情、深度行情数据推送。

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。

## 3.2.4.1 IMIX 报文示例

表13 MarketDataSnapshotFullRefresh 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	50	报文体长度
35		MsgType	W	报文类型
34		MsgSeqNum	34	报文序列号
52		SendingTime	20170206-11:14:00. 000	发送时间 格式：YYYYMMDD-HH:MM:SS. sss
49		SenderCompID	XXX	参见第二卷《通用功能》的“通用规则”章节的详细说明。
50		SenderSubID	XXX	
56		TargetCompID	XXX	
57		TargetSubID	XXX	
MessageBody				
262		MDReqID	MDAAAABBBB00000001	订阅请求 ID
1021		MDBookType	2	行情类型
48		SecurityID	XXX	债券代码
264		MarketDepth	5	档位信息，固定取值 5。
60		TransactTime	20130618-11:14:00. 123	业务发生时间
268		NoMDEntries	7	重复组个数 该场景取值不固定，以实际传输的个数为准
→	269	MDEntryType	B	B-成交
→	1020	TradeVolume	2000	可成交总量（元）
→	269	MDEntryType	4	4-开盘价
→	270	MDEntryPx	800. 8001	开盘净价（元）
→	269	MDEntryType	k	k-开盘到期
→	270	MDEntryPx	8. 8056	开盘到期（%）
→	269	MDEntryType	0	0-BID
→	1023	MDPriceLevel	1	档位信息 第一档
→	63	SettlType	1	清算速度
→	11609	UnMatchQty	1000	买入未匹配量（元）
→	271	MDEntrySize	10000000	最优行情时表示报买量（元）； 深度行情时表示报买可成交量（元）
→	270	MDEntryPx	800. 8055	报买净价（元）

→	235	YieldType	MATURITY	MATURITY-到期收益率
→	236	Yield	0.1166	报买到期(%)
→	269	MDEntryType	0	0-BID
→	1023	MDPriceLevel	2	档位信息 第二档
→	63	SettlType	1	清算速度
→	271	MDEntrySize	10000000	报买可成交量(元)
→	270	MDEntryPx	800.8055	报买净价(元)
→	235	YieldType	MATURITY	MATURITY-到期收益率
→	236	Yield	0.1166	报买到期(%)
→	269	MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023	MDPriceLevel	1	档位信息 第一档
→	63	SettlType	1	清算速度
→	11609	UnMatchQty	1000	卖出未匹配量(元)
→	271	MDEntrySize	10000000	最优行情时表示报买量(元); 深度行情时表示报卖可成交量 (元)
→	270	MDEntryPx	800.8088	报卖净价(元)
→	235	YieldType	MATURITY	MATURITY-到期收益率
→	236	Yield	0.1199	报卖到期(%)
→	269	MDEntryType	1	1-OFFER
→	1023	MDPriceLevel	2	档位信息 第二档
→	63	SettlType	1	清算速度
→	271	MDEntrySize	10000000	报卖可成交量(元)
→	270	MDEntryPx	800.8088	报卖净价(元)
→	235	YieldType	MATURITY	MATURITY-到期收益率
→	236	Yield	0.1199	报卖到期(%)
<b>StandardTrailer</b>				
10		Checksum	50	校验和

### 3.2.4.2 使用场景

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

表14 MarketDataSnapshotFullRefresh 使用场景

业务字段	IMIX 域	集中匹配	最优行情	深度行情
订阅请求 ID	262 MDReqID	选传	选传	选传
行情类型	1021 MDBookType	必传	必传	必传
债券代码	48 SecurityID	必传	必传	必传
清算速度	63 SettlType	必传	必传	必传
档位信息	264 MarketDepth	-	-	必传



业务字段	IMIX 域	集中匹配	最优行情	深度行情
	1023 MDPriceLevel			
业务发生时间	60 TransactTime	必传	必传	必传
买入未匹配量 (元)	当 269 MDEntryType=0 时 11609 UnMatchQty	有则必传	—	—
可成交总量(元)	当 269MDEntryType=B 时 1020 TradeVolum	有则必传	—	—
开盘净价(元)	当 269MDEntryType=4 时 270 MDEntryPx	有则必传	—	—
开盘到期(%)	当 269MDEntryType=k 时 270 MDEntryPx	有则必传	—	—
卖出未匹配量 (元)	当 269 MDEntryType=1 时 11609 UnMatchQty	有则必传	—	—
报买量(元)	当 269 MDEntryType=0 时 271 MDEntrySize	—	有则必传	—
报买可成交量 (元)	当 269 MDEntryType=0 时 271 MDEntrySize	—	—	有则必传
报买净价(元)	当 269 MDEntryType=0 时 270 MDEntryPx	—	有则必传	有则必传
报买到期(%)	当 269 MDEntryType=0, 235 YieldType=MATURITY 时 236Yield	—	有则必传	有则必传
报卖量(元)	当 269 MDEntryType=1 时 271 MDEntrySize	—	有则必传	—
报卖可成交量 (元)	当 269 MDEntryType=1 时 271 MDEntrySize	—	—	有则必传
报卖净价(元)	当 269 MDEntryType=1 时 270 MDEntryPx	—	有则必传	有则必传
报卖到期(%)	当 269 MDEntryType=1, 235 YieldType=MATURITY 时 236Yield	—	有则必传	有则必传

## 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
-