固定收益平台

STEP 协议报盘接口规格说明书

（V1.~~40~~50 版）

上海证券交易所

二〇二〇年十一月

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》1.50 版技术开发稿发布说明 2020.11~~10~~

1、 1.5.0 版本接口适用于 EzDA1.5.0 及以上 1.5.x 版本。

2、 调整利息字段长度，由之前 N16(2)调整为 N12(2)（详见 4.2.1、4.2.2、4.3.2、4.3.4、4.8.5、5.3、5.5）。

3、 未结算协议回购查询响应、未结算协议回购/三方回购落地文件的到期结算金额、参考应计利息字段赋值变更（详见 4.3.2、5.5）

4、 新增债券是否非担保信息落地文件（详见 5.7）。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》1.03 版发布说明 2019.07

1、 协议回购续做申报时，发起方投资者账户名称变更为必填项（详见 4.2.2）。

2、 修改非公开报价行情查询响应对手方投资者账户名称字段描述，协议回购到期续做申报行情时有效（详见 4.3.4）；修改非公开报价行情落地文件第 21 个字段正回购方证券账户名称的描述，协议回购到期续做申报行情时有效（详见 5.3）。

3、 修改成交执行报告查询响应中，三方回购转入转出时买卖方向字段的描述（详见 4.9.2）。

4、 修改公开报价行情、非公开报价行情落地文件默认刷新时间间隔（详见 5.1）。

5、 新增错误码 7061（详见 6.1）。

6、 修改章节点错误描述。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》1.02 版发布说明 2019.05

1、 补充协议交易买卖方向字段填写说明（详见 4.5.5）。

2、 补充成交执行报告响应消息的描述（详见 4.9.2）。

3、 过户数据（zgh）交易员代码英文字段名称修改为 trader_id（详见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》）。

4、 更新非公开报价行情落地文件中正回购方证券账户名称、正回购方投资者名称、逆回购方证券账户名称、逆回购方投资者名称的描述内容。（详见 5.3）

5、 更新未结算落地文件，逆回购产品委托人，逆回购方杠杆运作权限描述。（详见 5.5）。

6、 补充未结算落地文件，实际占款天数描述（详见 5.5）。

7、 更新错误码表（详见 6.1）。

8、 EzDAV1.0.7 版本上线，发布了正式版本。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》1.01 版发布说明 2018.12

1、 修改成交执行报告响应消息中 BasketGrp（标签 8529，8530）的赋值方式，仅业务类别为债券质押式三方回购指定对手方返回该组字段，对其他业务类别不返回该组字段。（详见 4.9.2）

2、 修改成交执行报告响应消息中参考应计利息（标签 159）的字段格式为 N12(8)，其他申报/响应消息中该标签所指字段字段类型不变。（详见 4.9.2）

3、 修改成交执行报告响应消息的描述，增加会员内部编号为空的场景说明。（详见 4.9.2）

4、 修改落地文件名称。（详见 5.1）

5、 修改非公开报价行情落地文件的行情更新类型赋值（详见 5.3）。

6、 修改订单状态落地文件的更新方式，由增量更新修改为全量更新。修改订单状态赋值，201 表示询价、202 表示被询价（被询价方报价）（详见 5.4）。

7、 修改未结算协议回购/三方回购落地文件中回购方向字段的格式说明。（详见 5.5）

8、 新增三方回购质押券所属篮子信息落地文件（详见 5.6）。

9、 将 EzDA 用户手册中的错误代码表迁移到接口规格说明书中。（详见 6.1）

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》1.0 版发布说明 2018.11

1、 修改成交执行报告响应，增加三方回购相关字段描述，增加质押券篮子信息字段（详见 4.9.2）

2、 更新协议回购消息处理流程（详见 4.1）

3、 新增现券订单类非交易申报/撤单消息：可交换债转股申报、债券回售申报/撤销、创新创业债转股冻结申报/撤销（流程说明详见 4.4.5、4.4.6、4.4.7，消息格式详见 4.5.8 及 4.5.9）

4、 新增现券订单类意向申报/意向申报撤单、意向申报响应/意向申报撤单响应消息（流程说明详见 4.4.8，消息格式详见 4.5.10 及 4.5.11）

5、 新增现券询价类消息（流程说明详见 4.4.9，消息格式详见 4.6）

6、 新增三方回购订单类消息（流程说明详见 4.7，消息格式详见 4.8）

7、 新增公开报价行情落地文件、非公开报价行情落地文件、订单状态落地文件、未结算协议回购/三方回购落地文件共四个落地文件（详见 5 落地文件）。公开报价行情落地文件包含现券意向申报、协议回购意向申报、三方回购意向申报行情信息。非公开报价行情落地文件包含询价、协议回购、三方回购的非公开报价行情信息。订单状态落地文件包含现券订单类（含非交易）、询价/被询价、协议回购类、三方回购类申报订单的订单状态变更信息。未结算协议回购/三方回购落地文件包含未结算协议回购及三方回购信息，供协议回购与三方回购报价申报使用。原协议回购未结算协议回购查询/响应、非公开报价行情查询/响应、公开报价行情查询/响应消息、报价状态变更查询/响应消息仍可使用，但不再扩展。以落地文件数据为准。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》0.5 版发布说明 2018.09

1、 迁移《IS112 固定收益平台电子报盘接口规格说明书>>现券订单类功能，新增 4.4 现券订单类流程说明和 4.5 现券订单类消息。

2、 增加质押式协议回购订单状态变更查询消息。

3、 3 数据格式约定中增加各消息类型对应业务类型编号。

4、 修改成交执行报告响应报文部分字段描述。成交执行报告查询报文的业务类型编号由“FPR”修改为“FSP”。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》0.3 版发布说明 2018.01

1、 配合固定收益平台增加投资者账户名称字段，具体为：报价申报消息增加“投资者账户名称”字段，修改“发起方重复组”字段的默认取值为 7；非公开报价行情响应消息增加“投资者账户名称”字段，修改“发起方重复组”字段的默认取值为 4。

2、 修改成交申报信息的质权人名称字段说明，将“质押式协议回购到期确认申报时填写”修改为“质押式协议回购到期续做确认申报时填写”。修改成交申报信息的成交申报时交易所成交日期字段说明，解除质押申报确认需要填写该字段。

3、 修改报价申报信息的质押券数量字段说明，将“到期续做申报时无意义”修改为“到期续做申报时填原质押券数量”。

4、 修改“到期续作”为“到期续做”。

5、 修改未结算协议回购查询响应的此次查询结束序号字段（16）说明，修改为“此次查询结束行情序号（全市场）”。

6、 修改协议回购订单类消息描述，增加：意向申报类、报价申报类消息填写成交金额字段时，以折算比例为基准进行计算。同时为避免产生歧义，删除意向申报类、报价申报消息的折算比例字段的计算公式说明。

7、 为避免产生歧义，修改非公开报价行情查询响应消息中，行情类型为“删除”的行情的“买卖方向”字段的默认返回值。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》0.28 版发布说明 2017.11

1、EzDAV0.2.8 版本上线，发布了正式版本。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》0.2 版发布说明 2017.8

1、发布了质押式协议回购意向申报，解除质押申报,质押式协议回购换券申报,质押式协议回购提前终止申报的 STEP 消息处理流程和消息定义,首次申报更改为成交申报。

《固定收益平台 STEP 协议报盘接口规格说明书》0.1 版发布说明 2016.10

1、发布了协议回购首次申报、到期续做申报和到期确认申报的 STEP 消息处理流程和消息定义。

本文档由上海证券交易所起草，并负责进行解释,以上变更启用安排参见相关业务或测试上线通知。

服务电话：021-4009003600

通信地址：上海市浦东南路 528 号上交所技术有限责任公司

网站地址：http://www.sse.com.cn/→交易技术支持专区“数据接口”栏目

目录

1 简介 9
2 会话机制 10
2.1 概要 10
2.2 消息格式 10
2.2.1 请求消息 10
2.2.2 响应消息 10
3 数据格式约定 12
4 消息定义 16
4.1 协议回购消息处理流程说明 16
4.1.1 意向申报 STEP 消息流程图 16
4.1.2 成交申报 STEP 消息流程图 17
4.1.3 存续期申报 STEP 消息流程图 18
4.2 协议回购订单类消息 19
4.2.1 意向申报消息/意向申报撤单消息 19
4.2.2 报价申报消息 21
4.2.3 报价申报响应消息 24
4.2.4 报价申报撤单消息 25
4.2.5 报价申报撤单响应消息 25
4.2.6 成交申报信息 26
4.2.7 成交申报响应消息 28
4.3 协议回购查询类消息 29
4.3.1 未结算协议回购查询 29
4.3.2 未结算协议回购查询响应 30
4.3.3 非公开报价行情查询 32
4.3.4 非公开报价行情响应 32
4.3.5 公开报价行情查询 34
4.3.6 公开报价行情响应 35
4.4 现券订单类流程说明 36
4.4.1 确定报价成交类（最优价成交和可转换成交）STEP 消息流程图 36
4.4.2 指定对手方报价 STEP 消息流程图 37
4.4.3 协议交易类 STEP 消息流程图 37
4.4.4 转托管 STEP 消息流程图 38
4.4.5 可交换债换股 STEP 消息流程图 39
4.4.6 债券回售 STEP 消息流程图 40
4.4.7 创新创业债转股 STEP 消息流程图 40
4.4.8 意向申报类 STEP 消息流程图 41
4.4.9 询价交易类 STEP 消息流程图 42
4.5 现券订单类消息 43

4.5.1 报价申报消息 43
4.5.2 报价申报响应消息 45
4.5.3 报价申报撤单消息 45
4.5.4 报价申报撤单响应消息 46
4.5.5 成交申报消息 46
4.5.6 成交申报撤单消息 48
4.5.7 成交申报响应/成交申报撤单响应消息 48
4.5.8 非交易申报/非交易撤单申报消息 49
4.5.9 非交易申报响应/非交易撤单申报响应 50
4.5.10 意向申报/意向申报撤单消息 51
4.5.11 意向申报响应/意向申报撤单响应 52
4.6 现券询价类消息 52
4.6.1 询价申报/询价申报撤销消息 52
4.6.2 询价申报/询价申报撤销响应消息 53
4.6.3 被询价方报价消息 54
4.6.4 被询价方报价响应消息 55
4.6.5 被询价方报价撤销消息 55
4.6.6 被询价方报价撤销响应消息 56
4.6.7 询价成交申报消息 56
4.6.8 询价成交申报响应消息 57
4.7 三方回购消息处理流程说明 57
4.8 三方回购订单类消息 63
4.8.1 意向申报/意向申报撤销消息 63
4.8.2 意向申报/意向申报撤销响应消息 64
4.8.3 转入转出申报 65
4.8.4 转入转出申报响应 66
4.8.5 报价申报消息 66
4.8.6 报价申报响应消息 70
4.8.7 报价申报撤销消息 71
4.8.8 报价申报撤销响应消息 71
4.8.9 成交申报消息 72
4.8.10 成交申报响应消息 75
4.9 执行报告查询类消息 75
4.9.1 成交执行报告查询 75
4.9.2 成交执行报告响应 76
4.9.3 报价状态变更查询 79
4.9.4 报价状态变更响应 80
5 落地文件 81
5.1 总览 81
5.2 公开报价行情 81
5.3 非公开报价行情 83

5.4.....订单状态 88
5.5.....未结算协议回购/三方回购 90
5.6.....三方回购质押券所属篮子信息 94
5.7.....债券是否非担保信息 94
6 附录 96
6.1.....错误代码表..... 96

1 简介

固定收益平台现有电子报盘接口基于 dbf 数据库表实现。为适应市场发展、满足交易商用户的数据直通需求，上交所根据近年来 STEP 协议的应用经验，制定了适用于固定收益平台业务的、基于 STEP 协议的数据交换协议。本文档即对该协议进行详细介绍。文档所采用的术语、消息格式、以及消息流描述均遵照 STEP 1.2 及 FIX 5.0 SP2 协议规范，同时上交所亦有特定的扩展。

和该协议相配套，上交所开发 STEP 协议电子报盘网关软件（EzDataAccess，以下简称 EzDA）。该报盘网关部署在用户处，实现基本的登录、心跳等功能，直连上交所固定收益平台后台。网关软件开放 TCP 服务，与用户端系统通过本文档定义的协议格式进行直接的数据交互。此外，在固定收益平台开盘期间，报盘网关会及时从固定收益平台获取确定报价行情、成交统计行情、成交明细行情、公告信息行情等内容，并保存到用户本地。收盘后，还将自动获取本方成交数据文件，保存到用户本地。

本文档适用于 EzDA1.~~4~~5.0 及以上版本。

关于电子报盘网关软件的详细使用说明，详见《TEC_FISP_EzDataAccess_用户手册》或登录 EzDA（1.1.2 及后续版本）后使用 Alt+F1 打开用户手册。

2 会话机制

2.1 概要

EzDataAccess 与用户端系统之间的交互采用客户端-服务器(C/S)架构，通过 TCP 链路通讯，其中 EzDataAccess 作为服务器端，用户端系统作为客户端。用户端系统首先需要向事先约定的 EzDataAccess 服务端口（默认为 7080）发起连接请求。

会话协议中的字段采用网络字节序传输。

2.2 消息格式

EzDataAccess 只支持一个会话。会话消息格式如下:

2.2.1 请求消息

序号	字段名称	说明	类型	[字节数]	备注
1.	msgLen	报文长度（二进制）	Int	4	后续数据的字节数，不包含自身
2.	reqid	**请求业务类型编号**	char	3	内容见数据格式约定章节
3.	fill13	**填充字符**	char	13	无意义
4.	reqtext	消息内容	char	-	变长字段，最大长度为 10*1024-16 数据格式为标准的 STEP 协议报文

注 1：完整报文为由报文头（msgLen+reqid+fill13）与报文体（即消息内容 reqtext）组成。

注 2：报文中不得出现回车符、换行符，以及保留字符~^|#*'&。

注 3：类型为 N 的字段默认值取 0，类型为 C 的字段默认值取空，且不能全为空格。**无意义字段可取默认值或其他值（须符合格式要求）。**

2.2.2 响应消息

序号	字段名称	说明	类型	[字节数]	备注
1.	msgLen	报文长度（二进制）	Int	4	后续数据的字节数，不包含自身
2.	complCod	错误标志	char	1	S：报价成功、 F：报价失败、 E：格式错误、 N：发送时出错 当前仅在查询类消息错误时在响应消息中使用该字段，为 F，其他情况该字段为空
3.	fill03	填充字段	char	3	无意义
4.	remark	处理结果的文字说明	char	50	

5.	resptext	消息内容	char	-	变长字段，最大长度为 10*1024*1024-58 数据格式为标准的 STEP 协议报文

注 1：订单类消息的报文响应参考 resptext，查询类消息的错误信息参考 complCod 及 remark。

3 数据格式约定

参见《上海证券交易所市场参与者 EzSTEP 通用数据库接口规格说明书》文档。

消息类型说明:

类型	类型	消息类型说明	业务类型编号	MsgType	请求类型	交易模式	申请类型
协议回购订单类	上传请求	意向申报和意向申报撤单	FPR	6	意向申报和意向申报撤单	申报	1140
						申报撤单	1141
		报价申报		S	协议回购成交申报	申报	1142
					协议回购到期续做申报	申报	1147
					协议回购解除质押申报	申报	1151
					协议回购换券申报	申报	1155
					协议回购提前终止申报	申报	1159
		报价申报撤单		Z	协议回购成交申报	申报撤单	1143
					协议回购到期续做	申报撤单	1148
					协议回购解除质押申报	申报撤单	1152
					协议回购换券申报	申报撤单	1156
					协议回购提前终止申报	申报撤单	1160
		成交申报		D	协议回购成交申报	确认	1144
						拒绝	1145
					协议回购到期续做	确认	1149
						拒绝	1150
					协议回购到期确认申报	申报	1146
					协议回购解除质押申报	确认	1153
						拒绝	1154
					协议回购换券申报	确认	1157
						拒绝	1158
					协议回购提前终止申报	确认	1161
						拒绝	1162
	后台响应	报价响应	/	AJ	对 S 和 6 的响应		
		报价状态报告		AI	对 Z 的响应		
		成交申报响应		8	对 D 的响应		
现券订单类	上传请求	报价申报	FDP	S	确定报价申报	申报	1500
		报价申报撤单		Z	确定报价申报&可转换成交申报	申报撤单	1501
		成交申报	FBP	D	最优价成交申报	申报	1502
			FDP		点击成交申报	申报	1503
			FLC		可转换成交申报	申报	1504
			FAT		协议交易申报	申报	1505
			FPT		指定对手方报价申报	申报	1507
		成交申报撤单	FAT	F	协议交易申报撤销	申报撤单	1506
			FPT		指定对手方报价申报撤销	申报撤单	1508
		非交易申报	FBT	U041	转托管申报	申报	1509
						申报撤单	1510
			FPO		债券回售申报	申报	1512
						申报撤单	1513
			FES		可交换债换股申报	申报	1511
					创新创业债转股（冻结）申报	申报	1514
						申报撤单	1515
		询价类申报	FIP	6	询价申报	申报	1518

						申报撤单	1519
				S	被询价方报价申报	申报	1520
					被询价方报价修改	申报	1549
				Z	被询价方报价申报撤销	申报撤单	1521
				D	询价成交申报	申报	1522
		意向申报	FII	6	意向申报和意向申报撤单	申报	1516
						申报撤单	1517
	后台响应	报价响应	/	AJ	对 S 和 6 的响应		
		报价状态报告		AI	对 Z 的响应		
		成交申报响应		8	对 D 和 F 的响应		
		非交易申报响应		U042	对 U042 的响应		
三方回购订单类	上传请求	意向申报和意向申报撤单	FTR	6	三方回购意向申报和意向申报撤单	申报	1523
						申报撤单	1524
		报价申报		S	三方回购指定对手方申报	申报	1525
					三方回购到期续做申报	申报	1530
					三方回购解除质押申报	申报	1534
					三方回购提前终止申报	申报	1538
					三方回购换券申报	申报	1542
		报价申报撤单		Z	三方回购指定对手方申报	申报撤单	1526
					三方回购到期续做申报	申报撤单	1531
					三方回购解除质押申报	申报撤单	1535
					三方回购提前终止申报	申报撤单	1539
					三方回购换券申报	申报撤单	1543
		成交申报		D	三方回购指定对手方申报	确认	1527
						拒绝	1528
					三方回购到期购回申报	申报	1529
					三方回购到期续做申报	确认	1532
						拒绝	1533
					三方回购解除质押申报	确认	1536
						拒绝	1537
					三方回购提前终止申报	确认	1540
						拒绝	1541
					三方回购换券申报	确认	1544
						拒绝	1545
					三方回购补券申报	申报	1546
		转入转出申报		U041	三方回购质押券转入申报	申报	1547
					三方回购质押券转出申报	申报	1548
	后台响应	报价响应	/	AJ	对 S 和 6 的响应		
		报价状态报告		AI	对 Z 的响应		
		成交申报响应		8	对 D 的响应		
		转入转出申报响应		U042	对 U041 的响应		
查询类	上传请求	未结算协议回购查询	FPR	U021	未结算协议回购查询（到期确认、到期续做、解除质押、换券、提前终止时，先查询相关然后申报）		3140
	后台响应	未结算协议回购查询响应	/	U022			/
	上传请求	成交执行报告查询	FSP	U023	成交执行报告查询		3139
	后台	成交执行报告响	/	U024			/

	响应	应				
	上传请求	非公开报价行情查询	FPR	U025	非公开报价行情查询（成交申报、到期续做、解除质押、换券、提前终止）	2007
	后台响应	非公开报价行情查询响应	/	U026		/
	上传请求	公开报价行情查询	FPR	U027	公开报价行情查询	2020
	后台响应	公开报价行情查询响应	/	U028		/
	上传请求	报价状态变更查询	FPR	U029	报价状态变更查询	3164
	后台响应	报价状态变更查询响应	/	U030		/

参与方组件说明:

参与方信息(448)	参与方角色 (452)
交易单元号	1 =发起方交易单元号
交易单元号	2 =对手方交易单元号
投资者帐户	5 =发起方投资者帐户
投资者帐户	6 =对手方投资者帐户
交易商代码	12 =发起方交易商代码
银行间托管账号	28 =银行间托管账号
交易商代码	37 =对手方交易商代码
投资者账户名称	38 =发起方投资者账户名称
交易员代码	101 =发起方交易员代码
交易员代码	102 =对手方交易员代码
交易商简称	103 =发起方交易商简称
交易商简称	104 =对手方交易商简称
质权人名称	105 =质权人名称
交易单元号	106 =发起方三方回购专用账户对应交易单元号
投资者账户	107 =发起方三方回购专用账户

请求业务类型编号（reqid），交易所据此处理不同的业务请求，取值为：

FPR = 协议回购(Fixed Income-PledgeRepurchase)

FAT=协议交易(FixedIncome-Agreed Trading)

FBP=最优价成交(Fixed Income-Best Price Trading)

FBT=转托管(FixedIncome-Bond Transfer)

FDP=确定报价(Fixed Income-Determined Price Quoting)

FLC=可转换成交(Fixed Income-Limited Convertible Trading)

FPT=指定对手方报价(Fixed Income-Promissory Trading)

FPO = 回售申报(Fixed Income-Bond Put Option)

FES = 债转股申报(Fixed Income-Debt for Equity Swap)

FIP=询价(FixedIncome-Inquired Price Trading)

FII=意向报价(Fixed Income-Indication Interest Quoting)

FTR = 三方回购(Fixed Income-Tri-party Repo)

FSP = 非指定业务类型

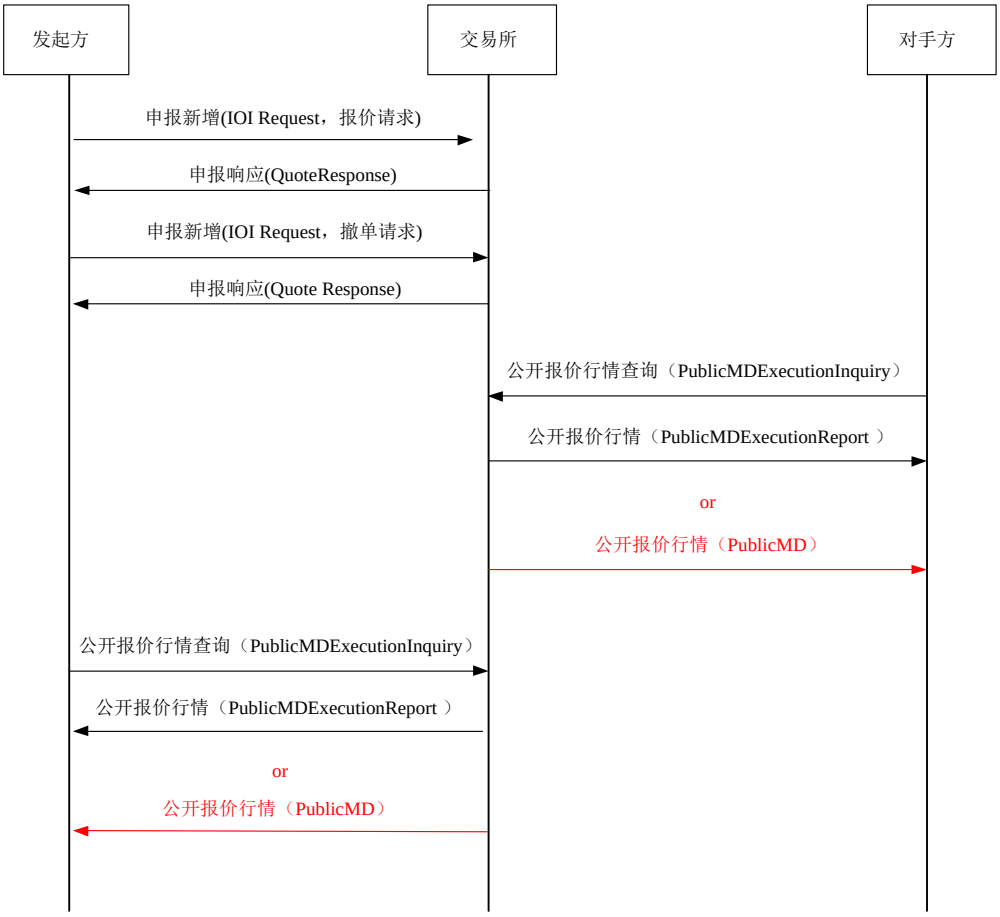
4 消息定义

4.1 协议回购消息处理流程说明

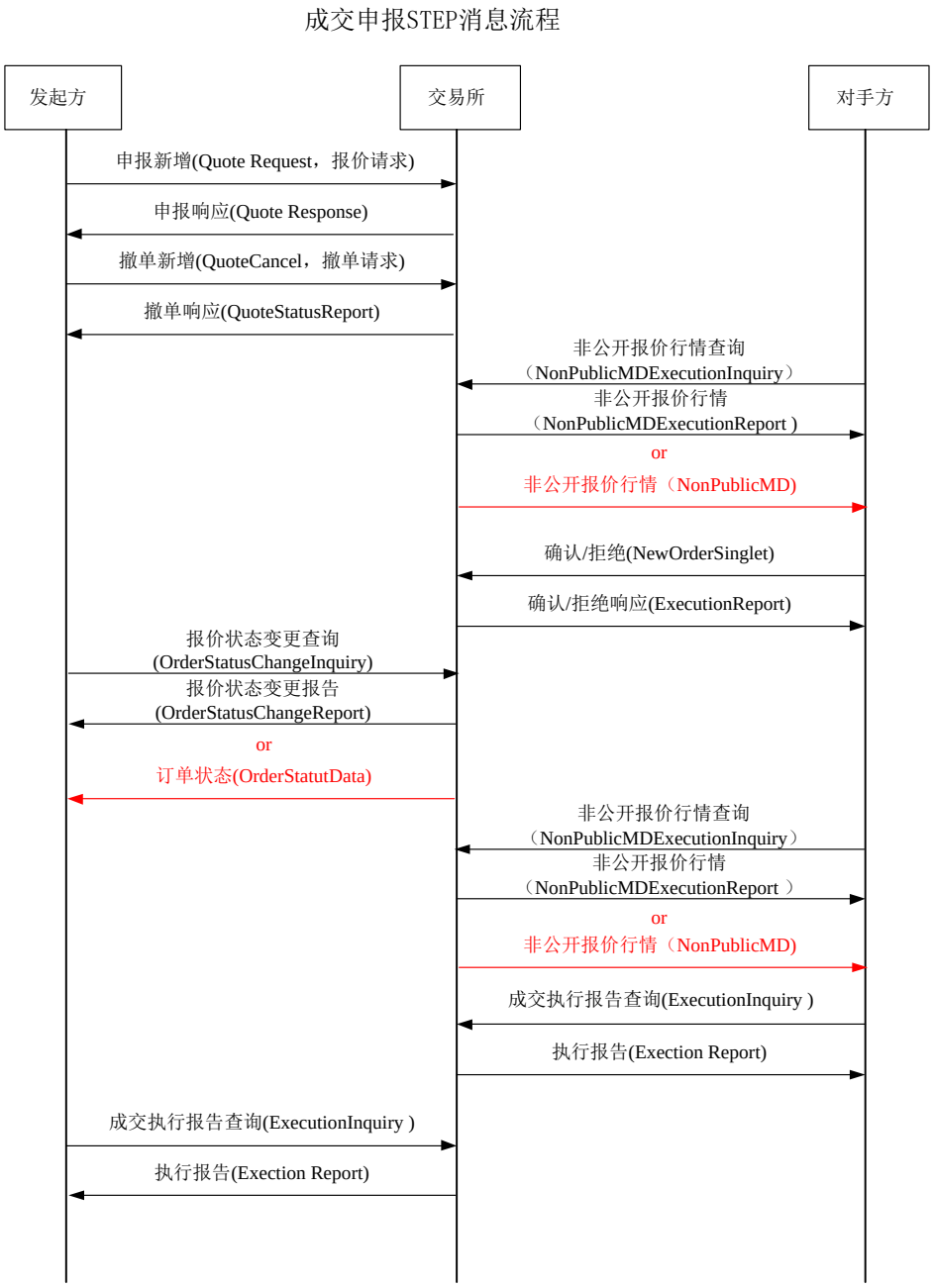
债券质押式协议回购（简称“协议回购”）是指交易双方自主谈判和协商议定，以债券为权利质押的融资业务。资金融入方（正回购方）在将债券出质给资金融出方（逆回购方）融入资金的同时，双方约定在未来某一日期，由正回购方向逆回购方返还本金，并按约定利率支付利息，同时解除债券质押登记解除。协议回购业务功能包括意向申报、成交申报、到期确认申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报。

4.1.1 意向申报 STEP 消息流程图

意向申报STEP消息流程

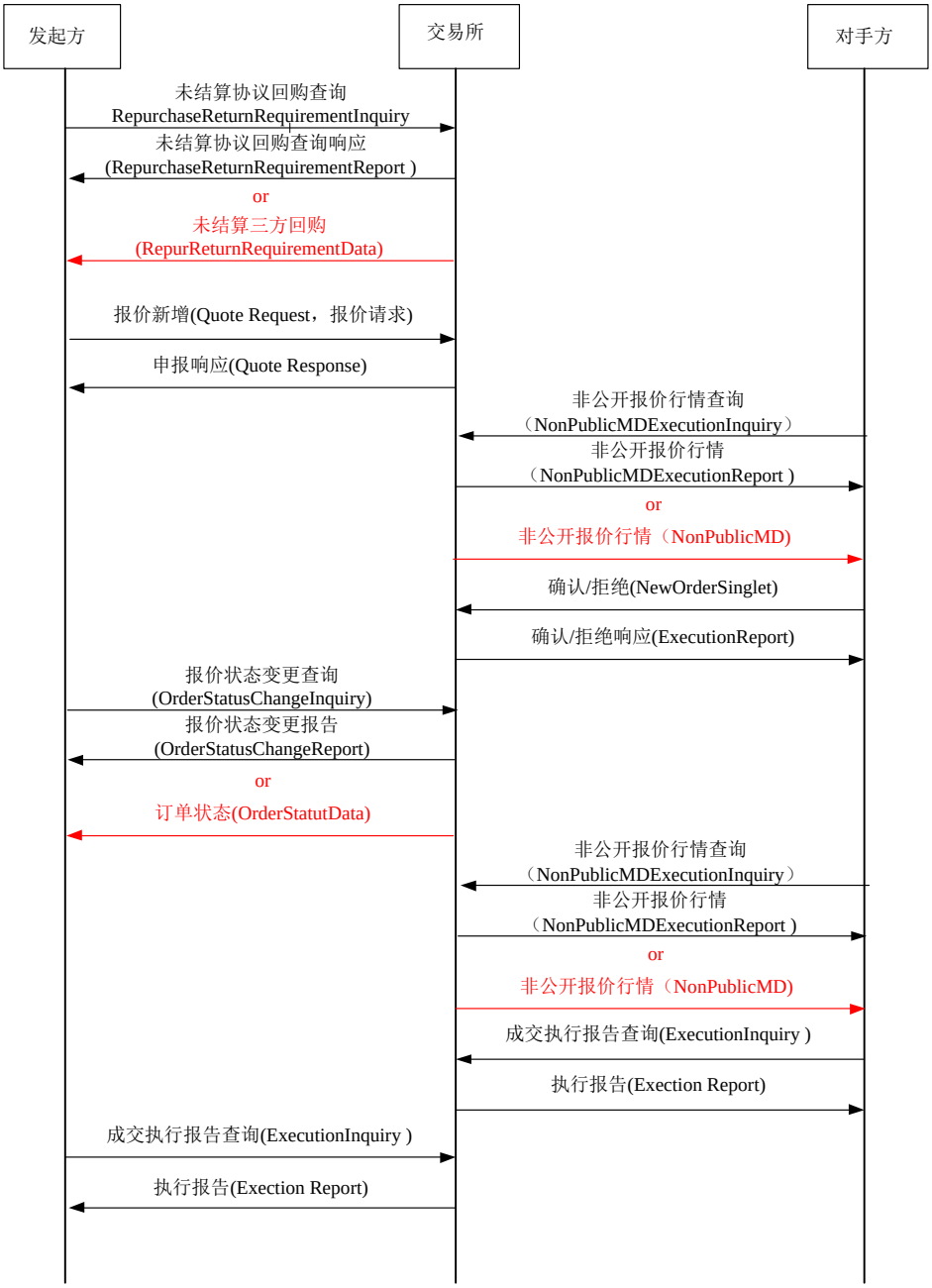


4.1.2 成交申报 STEP 消息流程图

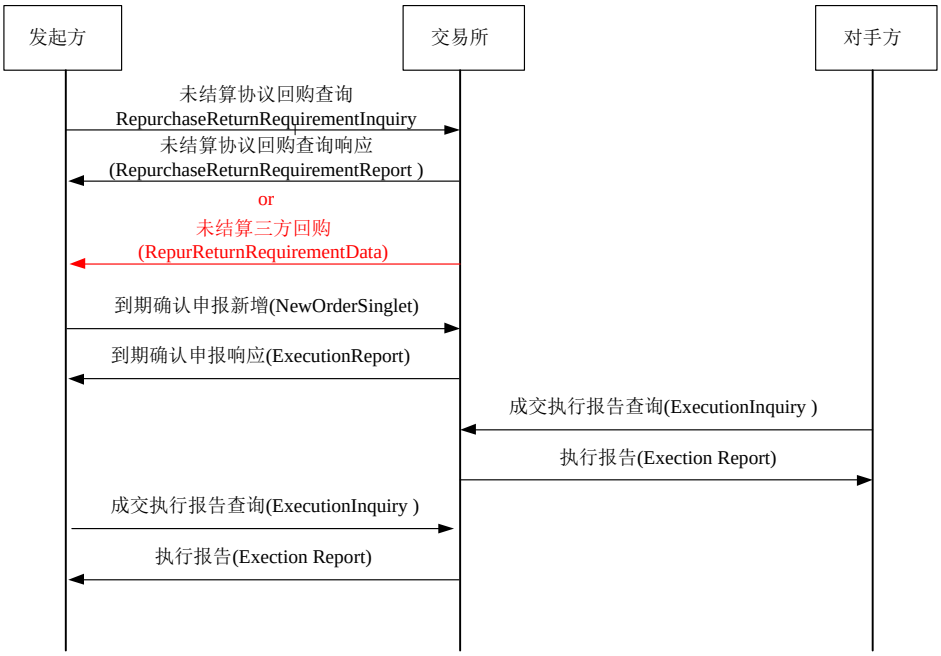


4.1.3 存续期申报 STEP 消息流程图

到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报STEP消息流程



到期确认申报STEP消息流程



4.2 协议回购订单类消息

reqtext/resptext	订单数据

描述：

本类消息用于市场参与者发送报价和获取报价的处理响应。

申报消息对应于同步请求消息流中的 reqtext 字段。

响应消息对应于同步确认消息流中的 resptext 字段。

意向申报类、报价申报类消息填写成交金额字段时，以折算比例为基准进行计算。

4.2.1 意向申报消息/意向申报撤单消息

IOI (reqtext)	意向申报消息/意向申报撤单消息

描述：

市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单。

需要注意的是，平台采用原始意向申报的会员内部编号和申报交易员作为撤单索引字段。

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= 6：意向申报或意向申报撤单	
23	IOIID	会员内部编号，指意向申报或意向申报撤单	C10

			会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	
537		QuoteType	报价类别 1140 = 质押式协议回购意向申报 1141 = 质押式协议回购意向申报撤单	N4
26		IOIRefID	撤单编号，意向申报撤单时填写被撤原订单的会员内部编号，意向申报时该字段无意义	C10
48		SecurityID	质押券代码	C6
44		Price	回购利率，单位：%，精度：3 位意向申报撤单时该字段无意义	N10(3)
226		RepurchaseTerm	回购期限，以天计，1-365 天 意向申报撤单时该字段无意义	N4
8847		UAInterestAccrualDays	实际占款天数，以天计，1-365 天。 意向申报撤单时该字段无意义	N3
64		SettlDate	首次结算日，格式为：YYYYMMDD 意向申报撤单时该字段无意义	C8
541		MaturityDate	回购到期日，格式为：YYYYMMDD 意向申报撤单时该字段无意义	C8
193		SettlDate2	到期结算日，格式为：YYYYMMDD 意向申报撤单时该字段无意义	C8
54		Side	协议回购方向，1 表示正回购，2 表示逆回购 意向申报撤单时该字段为意向申报时回购方向	C1
38		OrderQty	质押券数量，单位：手 意向申报撤单时该字段无意义	N10
32		LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数，质押债券面值总额=质押数量（手）*10*单张质押券面值 意向申报撤单时该字段无意义	N12
231		ContractMultiplier	折算比例,单位：%，精度：2 位意向申报撤单时该字段无意义	N6(2)
8504		TotalValueTraded	成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入，成交金额=质押券面值总额*折算比例 意向申报撤单时该字段无意义	N16(2)
159		AccruedInterestAmt	回购利息，单位：元，精度：2 位，四舍五入，回购利息=(成交金额*(回购利率/100)*实际占款天数)/365 意向申报撤单时该字段无意义	N12~~6~~(2)
119		SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期结算金额=成交金额+回购利息 意向申报撤单时该字段无意义	N16(2)
60		TransactTime	业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方的交易员代码。取值为 2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
58		Text	补充条款	C170

4.2.2 报价申报消息

Quote (reqtext)	报价申报

描述：市场参与者使用 Quote 消息进行报价申报。

用到本消息的申报类型协议回购成交申报、到期续做申报和换券申报**发起方只能为正回购方。**

成交申报支持批量申报，即支持一次性提交针对同一交易对手方、使用同一回购利率与同一回购期限的多个质押券交易申报。交易系统对提交的申报进行一次性确认（即同一批次中的申报要么全部成功，要么全部失败）。批量申报在对手方确认后,系统按质押券种进行拆分，每一种质押券（即每一质押券代码）对应一笔拆分后的成交申报，拆分后的每笔成交申报在后续业务处理中是相互独立的。

到期续做申报的质押券不得变更。续做申报须经续做逆回购方确认后生成新的回购合约，原到期回购合约终结。续做逆回购方可以是原回购的逆回购方也可以是新的第三方。交易系统后台将该续做申报拆分成两笔交易：一笔“到期续做前期合约了结”和一笔“到期续做合约新开”。

解除质押交易双方依约定在线下自行划付资金。

换券申报目前只支持全额替换。

提前终止申报指对于正常存续期（不含首次结算日和到期结算日）的回购交易，交易双方达成一致，提前结束协议回购合约，按照合约实际存续的期限和双方协商的利率进行结算。

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= S：报价申报	
117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537	QuoteType	报价类别 1142 = 质押式协议回购成交申报 1147 =质押式协议回购到期续做申报 1151 =质押式协议回购解除质押申报 1155 = 质押式协议回购换券申报 1159 = 质押式协议回购提前终止申报	N4
44	Price	回购利率，单位：%，精度：3 位 到期续做申报填新回购利率，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填实际回购利率	N10(3)
226	RepurchaseTerm	回购期限，以天计，1-365 天 到期续做申报填新回购期限，解除质押申	N4

			报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止后回购期限	
8847		UAInterestAccrualDays	实际占款天数，以天计，1-365 天 到期续做申报填新实际占款天数，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止后实际占款天数	N3
64		SettlDate	首次结算日，格式为：YYYYMMDD 到期续做申报填新的首次结算日，解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填提前终止日期	C8
541		MaturityDate	回购到期日，格式为：YYYYMMDD 到期续做申报填新的回购到期日，解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义	C8
193		SettlDate2	到期结算日，格式为：YYYYMMDD 到期续做申报填新的到期结算日，解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义	C8
54		Side	买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖 若为回购，则：1 表示正回购，2 表示逆回购 协议回购成交申报/到期续做申报/换券申报时只能填 1	C1
60		TransactTime	业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
UndInstrmtGrp				
711		NoUnderlyings	质押券个数，质押式协议回购成交申报最大为 10，其他报价类别为 1	N10
→	48	SecurityID	质押券代码，换券申报时填新质押券代码，到期续做申报、提前终止申报、解除质押申报时填原质押券代码	C6
→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手 做提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义，到期续做申报时填原质押券数量，换券申报时填新质押券数量	N10
→	231	ContractMultiplier	折算比例,单位：%，精度：2 位， 到期续做申报填新的折算比例，解除质押申报、提前终止申报时该字段无意义， 换券申报填新折算比例	N6(2)
→	8504	TotalValueTraded	成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入成交金额=质押券面值总额*折算比例 到期续做申报填新的成交金额（成交金额=质押数量（手）*10*单张质押券面值*(折算比例/100)），解除质押申报时该字段无意义，换券申报填成交申报时成交金额，提前终止申报填实际结算金额（实际结算金额=原成交金额+实际回购利息）	N16(2)
→	159	AccruedInterestAmt	回购利息，单位：元，精度：2 位，四舍五入，回购利息=(成交金额*(回购利率/100)*实际占款天数)/365 到期续做申报填新的回购利息（回购利息=(新回购成交金额*（新回购利率/100)*实际占款天数)/365），解除质押申报、换券申报时该字段无意义，提前终止申报填实	N1~~26~~(2)

			际回购利息(实际回购利息=(原成交金额*（实际回购利率/100)*实际占款天数)/365)	
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期结算金额=成交金额+回购利息 到期续做申报填新的到期结算金额(到期结算金额=新成交金额+新回购利息)，解除质押申报时该字段无意义，换券申报时填成交申报时到期结算金额，提前终止申报填成交申报时成交金额	N16(2)
→	32	LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数，质押债券面值总额=质押数量（手）×10×单张质押券面值 到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时该字段无意义，换券申报时填新券面总额合计	N12
192		OrderQty2	本期回购结算利息，到期续做申报时填写，成交申报、换券申报、提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义	N12~~6~~(2)
529		OrderRestrictions	到期续做类型 N 非第三方续做 Y 第三方续做 到期续做申报时填写，成交申报、换券申报、提前终止申报、解除质押申报时该字段无意义	C1
1125		OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期，到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，成交申报时该字段无意义	C8
19		ExecRefID	成交申报时交易所成交编号，引用未结算协议回购查询响应的成交编号，到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，成交申报时该字段无意义	N10
Parties				
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方的交易员代码、投资者账户、申报交易单元号，对手方交易商代码以及对手方交易员信息。取值为 7	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方	448	PartyID	发起方投资者账户名称，质押式协议回购	C30

投资者账户名称			成交申报、到期续做申报时必填，解除质押申报、换券申报、提前终止申报时该字段无意义	
	452	PartyRole	取 38，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户名称	N4
对手方交易商代码	448	PartyID	对手方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易商代码	N4
对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
58		Text	补充条款	C170

4.2.3 报价申报响应消息

QuoteResponse (resptext)	报价申报响应

描述：

同步确认消息流中的 resptext 字段数据。

每一个报价申报记录都分别有一个对应的响应消息。

市场参与者系统可以获得上交所处理报价申报,意向申报及撤单响应后返回的确认信息。

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AJ：报价申报响应	
537	QuoteType	响应类别 1140 = 质押式协议回购意向申报 1141 = 质押式协议回购意向申报撤单 1142 = 质押式协议回购成交申报 1147 = 质押式协议回购到期续做申报 1151 =质押式协议回购解除质押申报 1155 =质押式协议回购换券申报 1159 =质押式协议回购提前终止申报	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应	C1
102	CxlRejReason	意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 撤消成功时，该字段取值为空 撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段	C50
103	OrdRejReason	意向申报与报价申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 报价申报成功时，该字段取值为空 报价申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.2.4 报价申报撤单消息

QuoteCancel (reqtext)	报价申报撤单
描述： 市场参与者使用 Quote Cancel 消息进行报价申报撤单，对应请求流中的 ReqText 用到本消息的申报类型的质押式协议回购成交申报撤单，到期续做申报撤单，换券申报撤单，**发起方只能为正回购方。**需要注意的是，平台采用原始申报的会员内部编号和申报交易员作为撤单索引字段。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType= Z：报价申报撤单	
117		QuoteID	会员内部编号，指报价申报撤销会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
41		OrigClOrdID	原始交易会员内部编号，表示被撤消订单的 QuoteID	C10
537		QuoteType	报价类别 1143 = 质押式协议回购成交申报撤单 1148 = 质押式协议回购到期续做撤单 1152 = 质押式协议回购解除质押申报撤单 1156 = 质押式协议回购换券申报撤单 1160 = 质押式协议回购提前终止申报撤单	N4
48		SecurityID	质押券代码	C6
54		Side	买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖 若为回购，则：1 表示正回购，2 表示逆回购	C1
60		TransactTime	业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方交易员代码，取值为 2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
58		Text	备注	C50

4.2.5 报价申报撤单响应消息

QuoteStatusReport (RespText)	报价申报撤单响应
描述：	

QuoteStatusReport (RespText)	报价申报撤单响应
每一个报价申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理撤单申报后返回的确认信息。	

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AI：报价状态报告	
117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报撤单中的会员内部编号	C10
41	OrigClOrdID	对于报价申报撤单成功响应，为原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的 QuoteID，其他情况取值为空	C10
694	QuoteRespType	取值： 2=报价申报撤单响应	N1
297	QuoteStatus	报价状态，取值： 申报撤单成功响应=1， 申报撤单失败响应=8	N1
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 当报价状态不为 8 时，该字段取值为空 报价状态为 8 时，表示处理失败的理由，为错误代码加错误信息	C50

4.2.6 成交申报信息

NewOrderSingle (ReqText)	成交申报消息
描述： 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行报价成交申报，对应申报接口流中的 ReqText。质押式协议回购到期确认申报不支持撤单，只能由正回购发起业务，无需对手方确认。质押式协议回购成交申报,质押式协议回购到期续做、质押式协议回购换券申报的确认和拒绝发起方只能是逆回购方。质押式协议回购到期确认的原始信息通过未结算协议回购查询获取。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= D：成交申报	
11	ClOrdId	会员内部编号，指成交申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
6133	QuoteRefID	引用非公开报价行情的交易所报价请求编号，质押式协议回购成交申报确认/质押式	C10

			协议回购成交申报拒绝/质押式协议回购到期续做申报确认/质押式协议回购到期续做申报拒绝/质押式协议回购解除质押申报确认/质押式协议回购解除质押申报拒绝/质押式协议回购换券申报确认/质押式协议回购换券申报拒绝/质押式协议回购提前终止申报确认/质押式协议回购提前终止申报拒绝时填写，质押式协议回购到期确认申报时该字段无意义	
537		QuoteType	报价类别 1144=质押式协议回购成交申报确认 1145=质押式协议回购成交申报拒绝 1146=质押式协议回购到期确认申报 1149=质押式协议回购到期续做申报确认 1150=质押式协议回购到期续做申报拒绝 1153=质押式协议回购解除质押申报确认 1154=质押式协议回购解除质押申报拒绝 1157=质押式协议回购换券申报确认 1158=质押式协议回购换券申报拒绝 1161=质押式协议回购提前终止申报确认 1162=质押式协议回购提前终止申报拒绝	N4
48		SecurityID	质押券代码	C6
119		SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期确认申报时填写，其他申报时此字段无意义	N16(2)
54		Side	买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖若为回购，则：1 表示正回购，2 表示逆回购	C1
60		TransactTime	业务发生时间，格式为：YYYYMMDD-HH:MM:SS.sss	C21
1125		OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期，回购到期确认申报/到期续做申报确认/换券申报确认/提前终止申报确认/解除质押申报确认时填写，其他申报时此字段无意义	C8
19		ExecRefID	成交申报时交易所成交编号，回购到期确认申报时引用未结算协议回购查询响应消息的成交编号，到期续做申报确认/换券申报确认/提前终止申报确认/解除质押申报确认时引用非公开报价行情的交易所成交编号，其他申报此字段无意义	N10
Parties				
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码，发起方的交易员代码，质权人名称，发起方申报交易单元号，投资者账户，对手方交易商代码，对手方交易员代码。取值为 7	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
质权人名称	448	PartyID	质权人名称，质押式协议回购成交申报确认、质押式协议回购到期续做确认申报时	C30

			填写，其他申报此字段无意义	
	452	PartyRole	取 105，表示当前 PartyID 的取值为质权人名称	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号，成交申报拒绝、到期续做申报拒绝、换券申报拒绝、解除质押申报拒绝和提前终止申报拒绝时必须为空	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户，成交申报拒绝、到期续做申报拒绝、换券申报拒绝、解除质押申报拒绝和提前终止申报拒绝时必须为空	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
对手方交易商代码	448	PartyID	对手方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易商代码	N4
对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
58		Text	补充条款	C170

4.2.7 成交申报响应消息

ExecutionReport (RespText)	**成交申报响应**

描述：

每一个成交申报记录有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理成交申报后返回的确认信息。150 和 39 组合取值含义：成交申报成功响应：150=0, 39=0 成交申报拒绝响应：150=8, 39=8

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType 取值为：8=成交申报响应	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 申报成功时，该字段取值为空 申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.3 协议回购查询类消息

reqtext/resptext	订单数据
描述： 本类消息用于市场参与者发送查询类消息的处理响应。申报消息对应于同步请求消息流中的 reqtext 字段。 响应消息对应于同步确认消息流中的 resptext 字段。 类型为 N 的字段默认值取 0，类型为 C 的字段默认值取空。	

4.3.1 未结算协议回购查询

RepurchaseReturnRequirementInquiry（reqtext）	未结算协议回购查询
描述： 市场参与者使用此消息查询未结算的协议回购数据。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType 取值为 U021	
1346		ApplReqID	查询请求编号	N10
48		SecurityID	质押券代码，此处填写 ALL	C6
537		QuoteType	申请类型 3140 －未结算协议回购查询	N4
7		BeginSeqNo	起始序号（全市场），单调递增不连续，最小值为 0，最大值为 1000000000	N10
1180		ApplID	查询类型 1 到期结算查询申请 2 到期续做查询申请 3 解除质押查询申请 4 换券申报查询申请 5 提前终止查询申请	C11
297		QuoteStatus	到期状态 3 当日到期(查询类型到期结算和到期续做时填写 3) 4 未到期（查询类型为换券申报和提前终止时填写 4) 5 已过期（查询类型为解除质押时填写 5)	N1
453		NoPartyIDs	参与方个数，依次包含正回购方交易商代码，交易员代码，逆回购方交易商代码。取值为 3	N2
正回购方交易商代码	448	PartyID	正回购方交易商代码，填写 3 位 CompanyID 此处填写当前登录交易商代码	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4

正回购方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码 此处填写当前登陆交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
逆回购方交易商代码	448	PartyID	逆回购方交易商代码，填写 3 位 CompanyID 此处填写当前登录交易商代码	C3
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为逆回购方的交易商代码	N4

4.3.2 未结算协议回购查询响应

RepurchaseReturnRequirementReport (RespText)	未结算协议回购查询响应

描述：

响应市场参与者到期未结算协议回购查询。

一次查询最多返回自查询起始序号起 1000 条记录。

若查询结果无数据，响应消息报文截止到 16(EndSeqNo)字段。

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身。	
35		消息头	MsgType= U022：未结算协议回购	
1346		ApplReqID	查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的 ApplReqID	N10
16		EndSeqNo	此次查询结束行情序号（全市场）	N10
146		NoRelatedSym	记录笔数	N10
→	75	TradeDate	成交日期，格式为：YYYYMMDD	C8
→	17	ExecID	成交编号，质押式协议回购到期确认申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时上传此编号	N10
→	54	Side	回购方向，取值有：1 表示正回购，2 表示逆回购	C1
→	44	Price	回购利率，单位：%，精度：3 位	N10(3)
→	541	MaturityDate	回购到期日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	193	SettlDate2	到期结算日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	226	RepurchaseTerm	回购期限，单位：天，整数	N4
→	8847	UAInterestAccrualDays	实际占款天数，单位：天，整数	N3
→	48	SecurityID	质押债券代码	C6
→	55	Symbol	质押债券简称	C8
→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手	N10
→	32	LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数	N12
→	231	ContractMultiplier	折算比例,单位：%，精度：2 位	N6(2)
→	8504	TotalValueTraded	首次成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入	N16(2)
→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入，到期结算金额=首次成交金额+参考	N16(2)

				应计利息	
→	159	AccruedInterestAmt		参考应计利息,单位：元，精度：2 位，四舍五入 查询类型为换券申报查询申请时，返回参考应计利息为首次成交时参考应计利息 查询类型为其他类别申请时，返回参考应计利息由实际占款天数计算得到	N12~~6~~(2)
→	297	QuoteStatus		到期状态 3 当日到期 4 未到期 5 已到期	N1
→	453	NoPartyIDs		重复组，包含正回购方交易商代码、正回购交易商简称、正回购交易员代码、正回购交易单元、正回购证券账户、逆回购方交易商代码、逆回购交易商简称、逆回购交易员代码、逆回购交易单元、逆回购证券账户、质权人名称。取值为 11	N2
→	正回购方交易商代码	448	PartyID	正回购方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
		452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为正回购方的交易商代码	N4
→	正回购交易商简称	448	PartyID	交易商简称，填写 10 位交易商简称	C10
		452	PartyRole	取 103，表示当前 PartyID 的取值为正回购的交易商简称	N4
→	正回购交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
		452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为正回购的交易员代码	N4
→	正回购交易单元	448	PartyID	正回购申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号。	C5
		452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
→	正回购证券账户	448	PartyID	正回购投资者帐户	C10
		452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为正回购方投资者帐户	N4
→	逆回购方交易商代码	448	PartyID	逆回购方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
		452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为逆回购方的交易商代码	N4
→	逆回购交易商简称	448	PartyID	交易商简称，填写 10 位交易商简称	C10
		452	PartyRole	取 104，表示当前 PartyID 的取值为逆回购的交易商简称	N4
→	逆回购交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
		452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为逆回购的交易员代码	N4
→	逆回购交易单元	448	PartyID	逆回购申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
		452	PartyRole	取 2，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
→	逆回购证券账户	448	PartyID	逆回购投资者帐户	C10
		452	PartyRole	取 6，表示当前 PartyID 的取值为逆回购方投资者帐户	N4
→	质权人名称	448	PartyID	质权人名称	C30
		452	PartyRole	取 105，表示当前 PartyID 的取值为质权人名称	N4

4.3.3 非公开报价行情查询

NonPublicMDExecutionInquiry(reqtext)	非公开报价行情查询
描述： 市场参与者查询非公开报价行情。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType 取值为 U025	
1346		ApplReqID	查询请求编号	N10
537		QuoteType	申请类别 2007 —成交申报非公开报价行情查询	N4
7		BeginSeqNo	起始行情序号（全市场），最小值为 0，最大值为 1000000000	N10
453		NoPartyIDs	参与方个数，依次为查询方方交易商代码，交易员代码。取值为 2	N2
查询方交易商代码	448	PartyID	查询方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易商代码	N4
查询方交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易员代码	N4

4.3.4 非公开报价行情响应

NonPublicMDExecutionReport(reqtext)	非公开报价行情响应
描述： 响应市场参与者非公开报价行情查询。 行情更新类型为删除(279=2)时，仅标签：6133，279，40 有业务含义，其他字段值默认为空或 0，买卖方向为一个空格。 一次查询最多返回自查询起始序号起 1000 条记录。 若查询结果无数据，响应消息报文截止到 16(EndSeqNo)字段。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= U026：非公开报价行情	
1346	ApplReqID	查询请求编号，该字段对应查询请求	N10

				消息中的 ApplReqID	
16		EndSeqNo		此次查询结束行情序号（全市场）	N10
146		NoRelatedSym		记录笔数	N10
→	6133	QuoteRefID		交易所报价请求编号，质押式协议回购成交申报确认/拒绝、质押式协议回购到期续做确认/拒绝、质押式协议回购解除质押申报确认/拒绝，质押式协议回购换券申报确认/拒绝，质押式协议回购提前终止确认/拒绝时上传此编号	C10
→	279	MDUpdateAction		行情更新类型，取值：新增=0，删除=2	C1
→	40	OrdType		报价申报类型，取值： 成交申报=F 到期续做=X 解除质押=C 换券申报=H 提前终止=Z	C1
→	44	Price		回购利率，单位：%，精度：3 位	N10(3)
→	226	RepurchaseTerm		回购期限，单位：天，整数	N4
→	8847	UAInterestAccrualDays		实际占款天数，单位：天，整数	N3
→	64	SettlDate		首次结算日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	541	MaturityDate		回购到期日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	193	SettlDate2		到期结算日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	54	Side		买卖方向，取值有：1 表示正回购	C1
→	UndInstrmtGrp				
→	711	NoUnderlyings		质押券个数,最大 10	N10
→	→	48	SecurityID	质押券代码	C6
→	→	308	UnderlyingSecurityID	原质押券代码,换券申报时有效，其他为空	C6
→	→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手	N10
→	→	231	ContractMultiplier	折算比例,单位：%，精度：2 位	N6(2)
→	→	8504	TotalValueTraded	成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入	N16(2)
→	→	879	UnderlyingQty	原成交申报成交金额，换券申报行情时有效，其他为 0	N16(2)
→	→	159	AccruedInterestAmt	回购利息，单位：元，精度：2 位，四舍五入	N12~~6~~(2)
→	→	119	SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入	N16(2)
→	→	32	LastQty	质押券面总额合计，单位：元，整数，到期续做行情时为 0	N12
→	529	OrderRestrictions		到期续做类型 N 非第三方续做 Y 第三方续做 到期续做行情时有效	C1
→	1125	OrigTradeDate		成交申报时交易所成交日期，到期续做，换券申报，提前终止申报，解除质押申报行情时有效	C8

→	19	ExecRefID		交易所成交编号，到期续做，换券申报，提前终止申报，解除质押申报行情时有效	N10
→	453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含本方交易商，对手方的交易商代码、对手方交易员代码，值为 4	N2
→	本方交易商代码	448	PartyID	本方交易商代码，为 3 位 CompanyID	C3
→		452	PartyRole	为 12，表示当前 PartyID 的取值为本方的交易商代码	N4
→	对手方交易商简称	448	PartyID	对手方交易商简称，为 10 位简称	C10
→		452	PartyRole	为 103，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易商简称	N4
	对手方投资者账户名称	448	PartyID	对手方投资者账户名称，成交申报、到期续做申报行情时有效， 提前终止申报，换券申报，解除质押申报行情时该字段无意义	C30
		452	PartyRole	为 38，表示当前 PartyID 的取值为对手方的投资者账户名称	N4
→	对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，为 6 位交易员代码	C6
→		452	PartyRole	为 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
→	58	Text		备注	C170

4.3.5 公开报价行情查询

PublicMDExecutionInquiry(reqtext)	**公开报价行情查询**
描述: 市场参与者查询公开报价行情。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType 取值为 U027	
1346		ApplReqID	查询请求编号	N10
537		QuoteType	申请类别 2020 －成交申报公开报价行情查询	N4
7		BeginSeqNo	起始行情序号（全市场），最小值为 0，最大值为 1000000000	N10
453		NoPartyIDs	参与方个数，依次为查询方方交易商代码,交易员代码。取值为 2	N2
查询方交易商代码	448	PartyID	查询方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易商代码	N4
查询方交易员	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为查询方的	N4

号			交易员代码	

4.3.6 公开报价行情响应

PublicMDExecutionReport(reqtext)	公开报价行情响应

描述：

响应市场参与者公开报价行情查询。一次查询最多返回自查询起始序号起 1000 条记录。

若查询结果无数据，响应消息报文截止到 16(EndSeqNo)字段。

标签		字段名		字段描述	类型
9		消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头		MsgType= U028：公开报价行情	
1346		ApplReqID		查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的 ApplReqID	N10
16		EndSeqNo		此次查询结束行情序号（全市场）	N10
146		NoRelatedSym		记录笔数	N10
→	6133	QuoteRefID		交易所报价编号	C10
→	279	MDUpdateAction		行情更新类型，取值：新增=0，删除=2	C1
→	40	OrdType		报价申报类型，取值： 协议回购意向报价=Y	C1
→	48	SecurityID		质押券代码	C6
→	55	Symbol		质押券简称	C8
→	54	Side		协议回购方向 1 表示正回购，2 表示逆回购	C1
→	44	Price		回购利率，单位：%，精度：3 位	N10(3)
→	38	OrderQty		质押券数量，单位：手	N10
→	231	ContractMultiplier		折算比例,单位：%，精度：2 位	N6(2)
→	226	RepurchaseTerm		回购期限，以天计，1-365 天	N4
→	8504	TotalValueTraded		成交金额，单位：元；精度：2 位，四舍五入	N16(2)
→	64	SettlDate		首次结算日，格式为：YYYYMMDD	C8
→	453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方交易商，发起方交易员代码，取值为 2	N2
→	发起方交易商简称	448	PartyID	发起方交易商简称	C10
		452	PartyRole	取 103，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商简称	N4
→	发起方申报交易员代码	448	PartyID	交易员代码，为 6 位交易员代码	C6
		452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

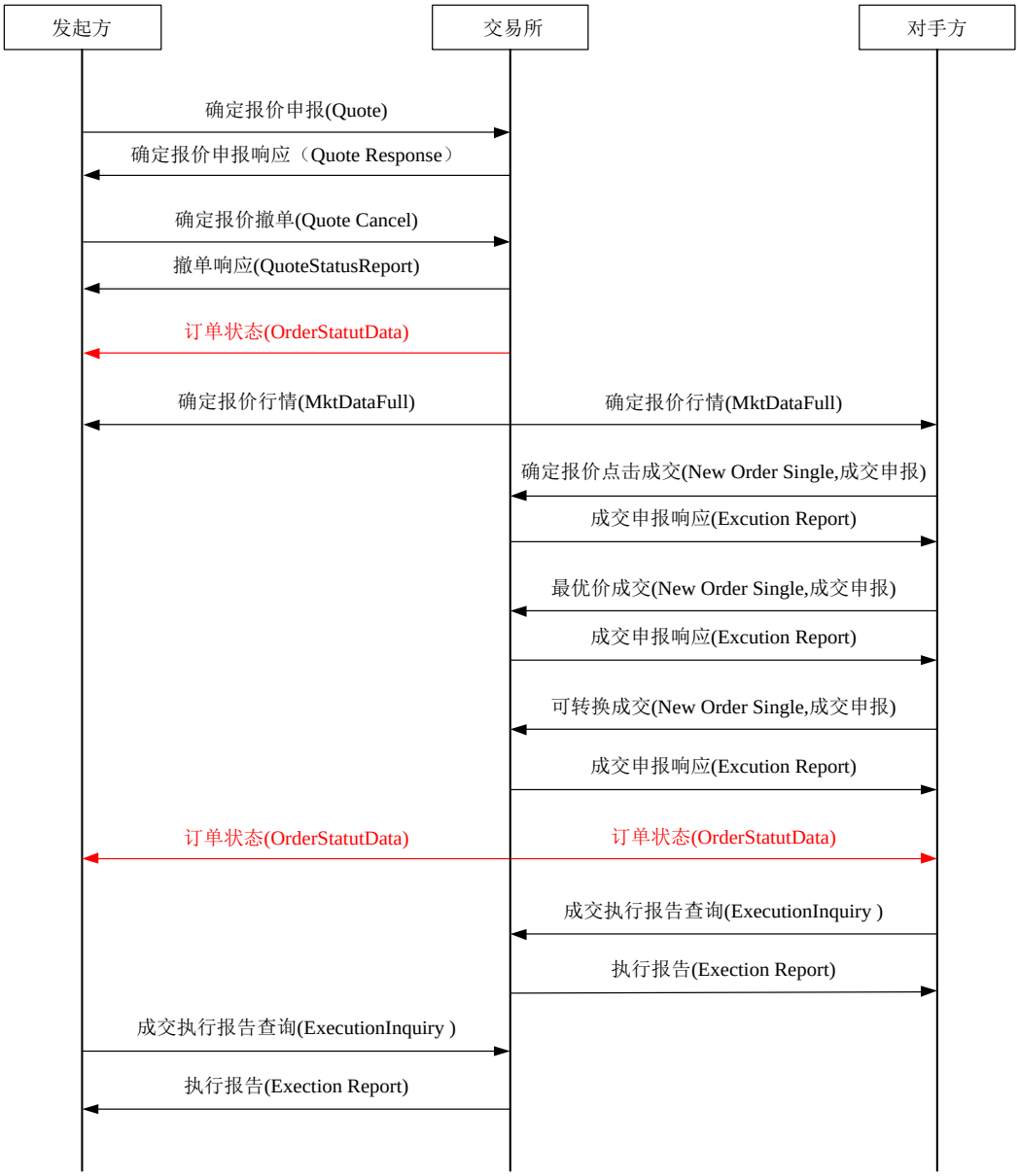
4.4 现券订单类流程说明

4.4.1 确定报价成交类（最优价成交和可转换成交）STEP 消息流程图

确定报价是可执行报价（实价），可以同时录入双边报价或单边报价，双边报价相当于同时输入一份限价买入订单和限价卖出订单，而单边报价相当于一份限价买入或卖出订单。确定报价担保券卖出申报时，需要检查并冻结投资者的持仓。根据确定报价与成交类流程，市场投资者可以进行包括确定报价的申报、撤单与点击成交。

执行报告中类型标识的取值与对应的发起方的请求类型标识相一致。

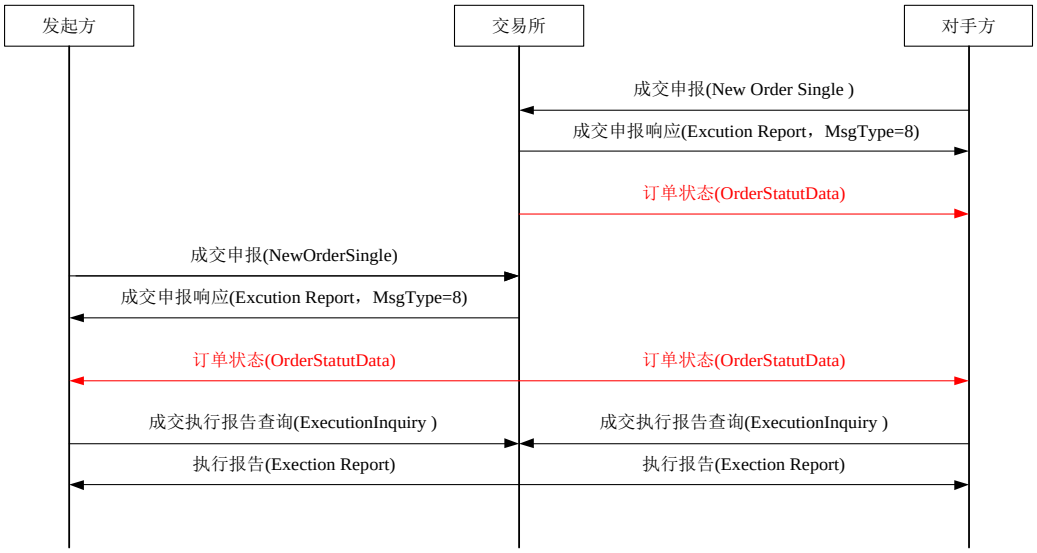
确定报价成交类申报STEP消息流程



4.4.2 指定对手方报价 STEP 消息流程图

“指定对手方报价类”功能包括指定对手方的申报、撤单，下图描述了指定对手方报价的 STEP 消息通信流程。

指定对手方报价STEP消息流程



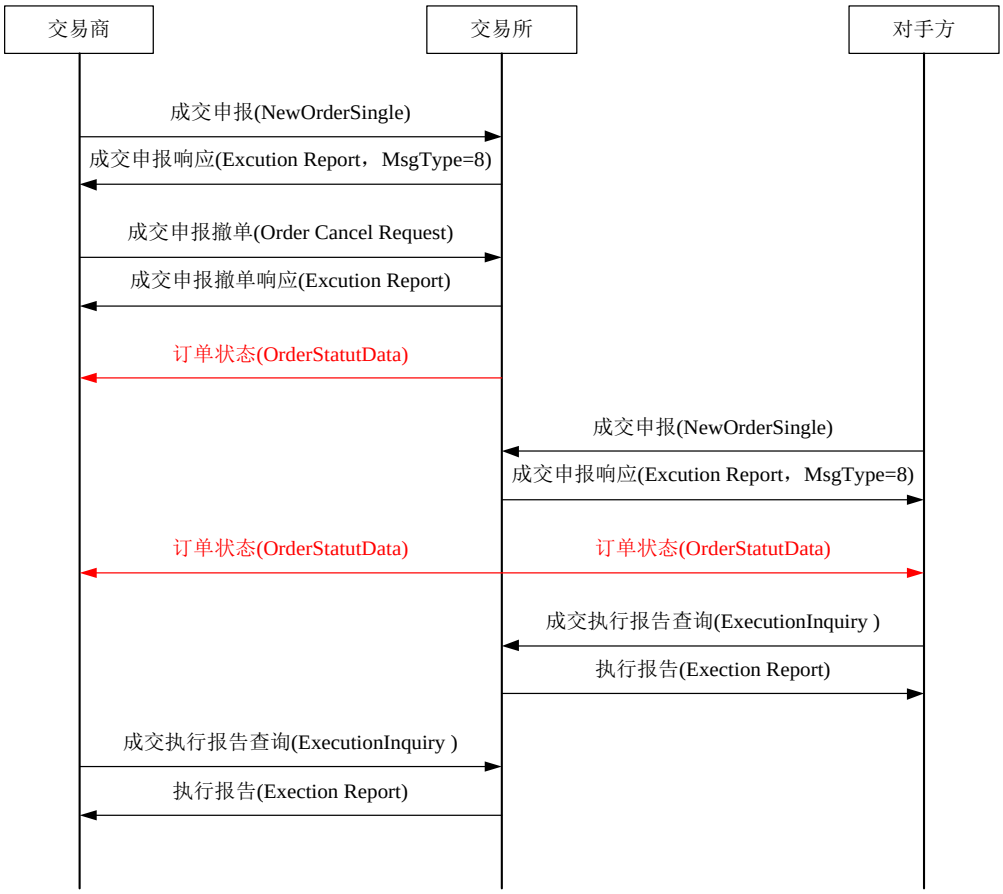
4.4.3 协议交易类 STEP 消息流程图

协议交易是交易商与其客户达成的交易，由同一交易商录入两笔交易申报，相互匹配而成。其中一笔代表其所属的交易商录入，另一笔代表其客户录入。

协议交易是非担保交收的操作，系统不对协议交易申报进行持仓的前端控制和余额调整。协议交易的成功与否由登记公司判定，并通过日末的非交易过户数据文件反馈给固定收益平台。

“协议交易类”功能包括协议交易的申报、撤单，下图描述了协议交易类的 STEP 消息通信流程。

协议交易STEP消息流程



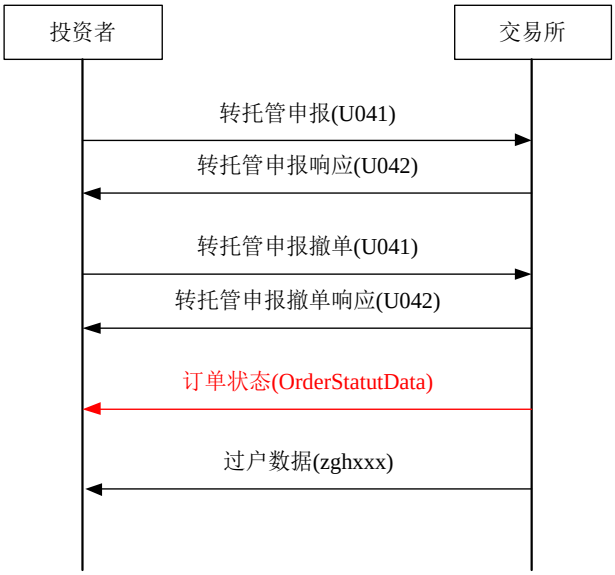
4.4.4 转托管 STEP 消息流程图

目前，我国债券市场由几个相互分割的市场，即银行间债券市场、交易所市场、商业银行柜台市场以及凭证式国债市场等组成。债券的中央托管分别由中国证券登记结算公司和中央国债登记结算公司负责。投资者要在不同市场进行交易，必须在不同的市场分别开立债券账户，而债券在不同市场之间的流动必须通过在同一个投资者的不同债券账户之间办理转托管。

转托管是非担保交收的操作，系统不对转托管申报进行持仓的前端控制和余额调整，仅对申报转出账户进行指定关系检查。交易商可以在现券开盘期间进行转托管登记，成功与否由登记公司判定，在日终结算公司处理完成后，第二天持有余额调整。转托管记录以结算公司最终传回系统的非交易过户数据文件为准。

“转托管”功能包括转托管的申报、撤单，下图描述了转托管的 STEP 消息通信流程。

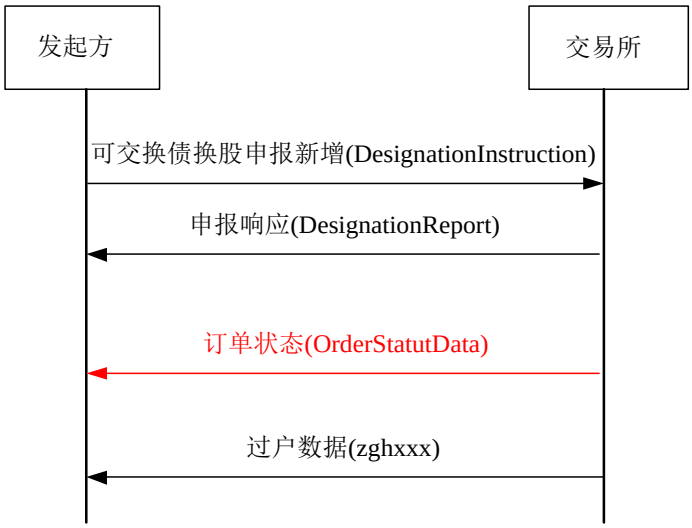
转托管STEP消息流程



4.4.5 可交换债换股 STEP 消息流程图

非公开发行的可交换公司债券在固定收益平台挂牌交易，进入换股期后可以通过固定收益平台进行换股申报，交换为预备用于交换的股票。可交换债转股类目前仅包含可交换债换股申报，换股成功后不可撤销。仅针对可交换公司债券有效。

可交换债换股申报STEP消息流程

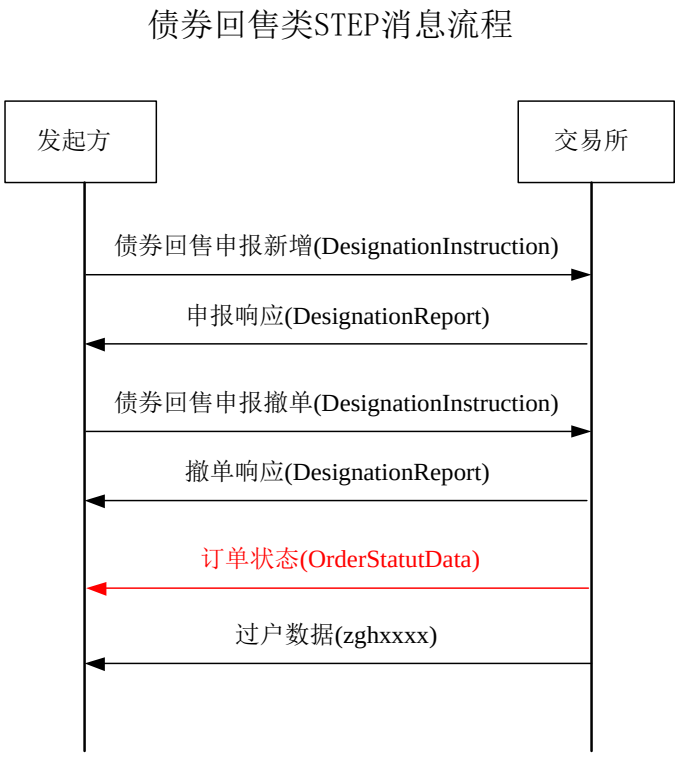


4.4.6 债券回售 STEP 消息流程图

债券回售是指债券持有人（投资者）将所持债券依照原约定的回售价格，回售（即卖出）给发行人的行为。

非公开发行公司债券可在固定收益平台实现回售申报业务。

交易员可撤销自己创建的回售申报。



4.4.7 创新创业债转股 STEP 消息流程图

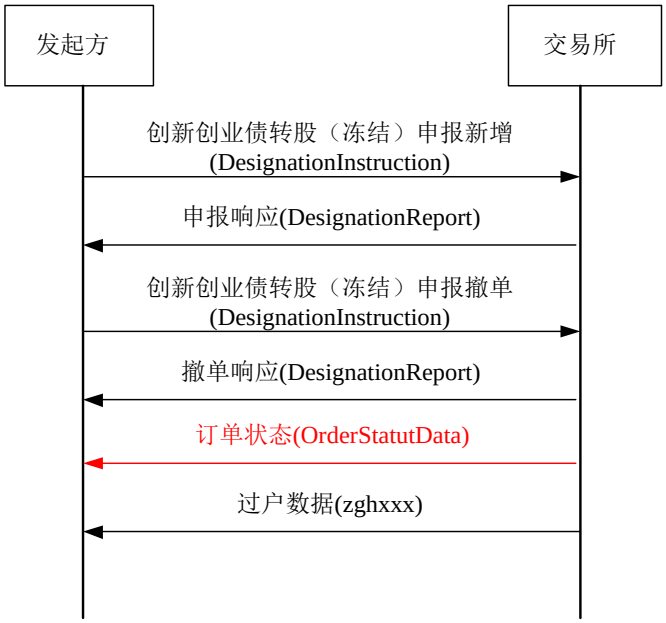
创新创业债转股是指债券持有者（投资者）将所持债券依照原约定的转股价格，转股（即冻结、解冻）给发行人的行为。

创新创业公司非公开发行可转换公司债券（简称“创新创业可转债”）可在固定收益平台进行转股申报业务。

目前仅支持进行创新创业债转股冻结申报及冻结申报撤单操作。

创新创业债转股申报解冻申报及解冻申报撤单目前仅可通过场务端进行。

创新创业债转股类STEP消息流程

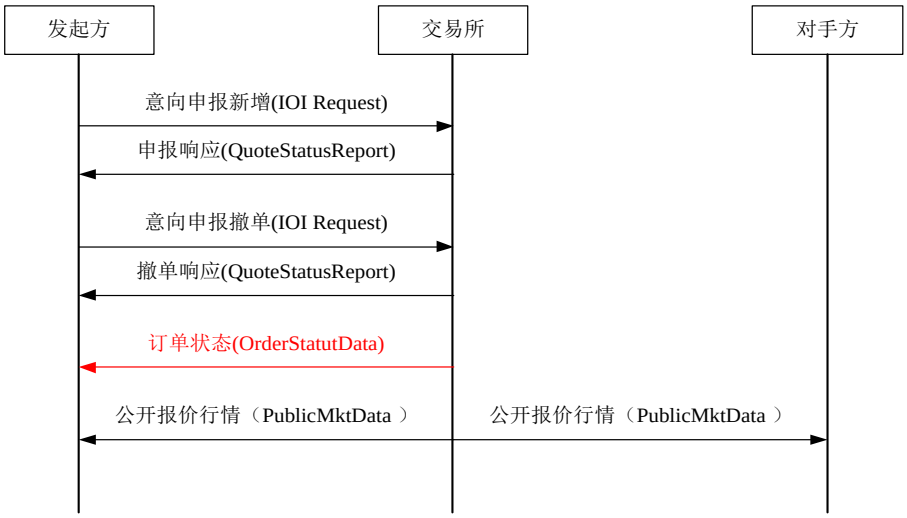


4.4.8 意向申报类 STEP 消息流程图

意向申报类包括意向申报与撤销，仅支持私募债产品和托管在中央结算的信贷资产支持证券产品。

意向申报不进行前端控制，不支持匿名，可随时撤销。

现券意向申报STEP消息流程



4.4.9 询价交易类 STEP 消息流程图

询价类交易包括询价方的询价申报、询价申报撤销、询价成交与被询价方的报价申报、报价申报修改、报价申报撤销。询价类消息支持国债、担保公司债、非担保公司债（不含私募债）产品，包括托管在中央结算的信贷资产支持证券、国债、地方债、企业债等产品。

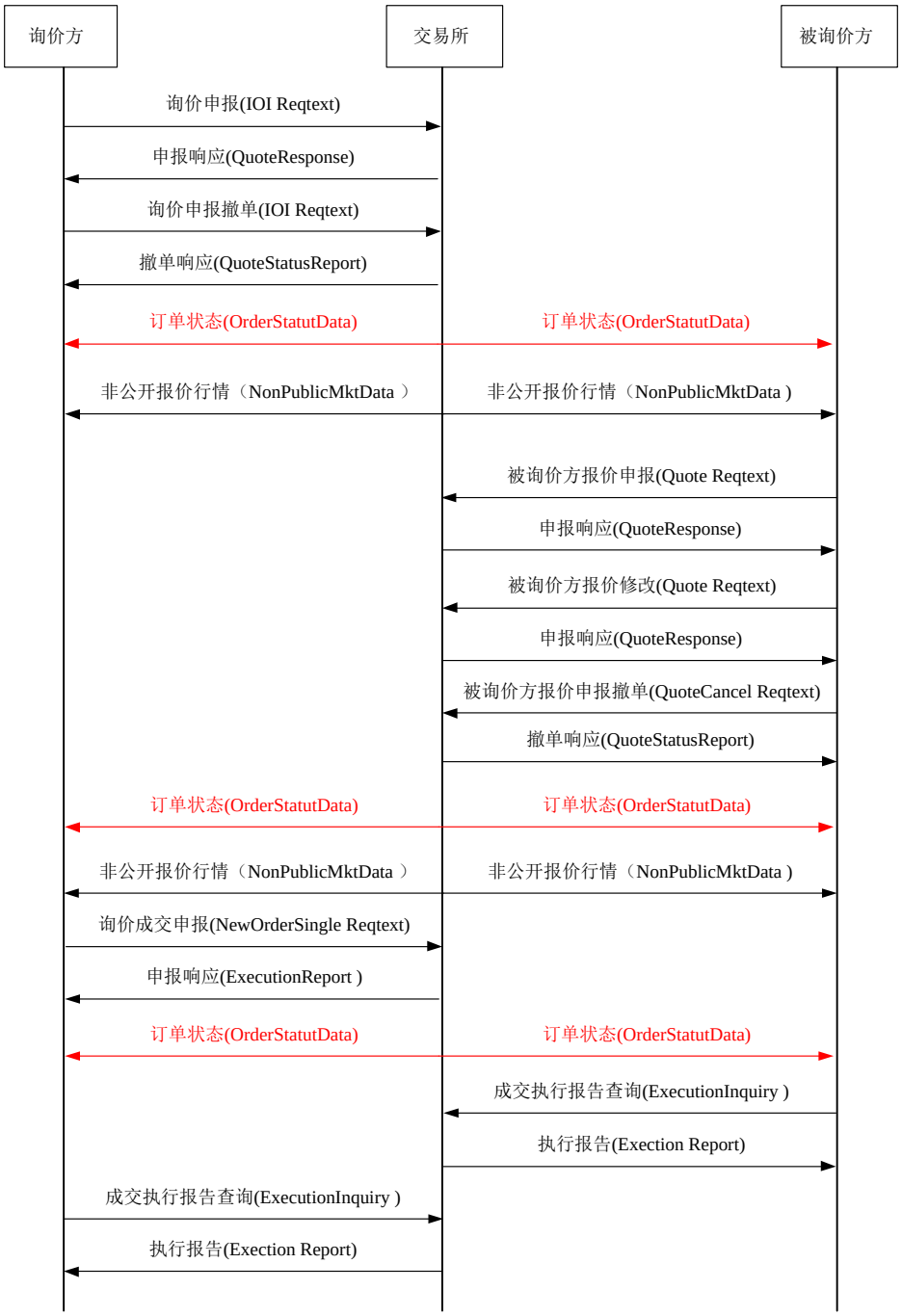
市场参与者可以向不超过规定数量（目前为 5）的多个市场参与者（其中普通交易商数量最多为 1，做市商最多为 5）发出询价请求，要求就特定数量的债券的买入或卖出价格进行报价。询价不能匿名发送，超过规定时间（目前为 20 分钟）的询价将被撤销，系统不对询价进行持仓的前端控制和余额调整。

询价未成交前，且未超过系统规定时间，所有交易员可撤销自己的询价。

交易商在接收到询价请求后，应在规定时间内向原询价方报出买卖价格，超过规定时间自动失效。询价未成交前，且未超过系统规定时间，所有交易员可撤销自己的报价。被询价方撤销后，该笔发送给该被询价方的询价也被撤销。询价方撤销询价，则所有回复给询价方的报价同时被撤销。

询价方在收到被询价方的报价回复后，可进行询价成交申报。每条询价（每条询价可能包含多笔询价报价回复）只能有一笔成交，与一条报价回复确认成交后，则该条询价结束。

询价交易STEP消息流程



4.5 现券订单类消息

4.5.1 报价申报消息

Quote (reqtext)	报价申报
描述：	

Quote (reqtext)	报价申报
请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 Quote 消息进行报价申报。 用到本消息的申报类型有确定报价申报。	

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= S：报价申报	
117	QuoteID		会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
537	QuoteType		报价类别 1500 =确定报价申报	N4
1091	PreTradeAnonymity		是否匿名报价，取值：匿名=1，具名=0 确定报价申报可填写 1，其他不能填写 1	C1
529	OrderRestrictions		是否做市报价，取值：做市报价=5，非做市报价=0 做市报价申报填写 5，其他均填写 0	C1
48	SecurityID		证券代码	C6
54	Side		买卖方向，取值有：0 表示双向，1 表示买，2 表示卖	C1
38	OrderQty		订单数量，单位：手 在 side 为双向时表示买数量，其他情况表示 side 对应的数量	N10
32	LastQty		订单数量 2，单位：手 在 side 为双向时填写卖数量，其他情况填写 0	N10
44	Price		订单价格(净价)，单位：元，精度：3 位。在 side 为双向时填写买价格，其他情况表示 side 对应的价格	N10(3)
640	Price2		订单价格(净价)2，单位：元，精度：3 位。在 side 为双向时填写卖价格，其他情况填写 0	N10(3)
1138	DisplayQty		冰山订单数量，单位：手 如果不为冰山订单，则此字段为 0	N10
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户，取值为 4	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4

4.5.2 报价申报响应消息

QuoteResponse (resptext)	报价申报响应消息

描述：

响应接口流中的 resptext 字段数据。

每一个报价申报记录都分别有一个对应的响应消息。

市场参与者系统可以获得上交所处理报价申报后返回的确认信息。

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType 取值为：AJ=报价申报响应 或 报价请求及撤单响应 或 意向申报及撤单响应。	
537	QuoteType	报价类别 1500 =确定报价申报	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息中的 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应	C1
103	OrdRejReason	报价请求报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 报价申报成功时，该字段取值为空 报价申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	C50

4.5.3 报价申报撤单消息

QuoteCancel (reqtext)	报价申报撤单

描述：

市场参与者使用 Quote Cancel 消息进行报价申报撤单，对应请求流中的 ReqText

用到本消息的申报类型有确定报价申报撤单、可转成交申报撤单

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= Z：报价申报撤单	
117	QuoteID		会员内部编号，指报价申报撤销会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID		原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的 QuoteID	C10
537	QuoteType		报价类别 1501 = 确定报价申报撤销或可转成交申报撤销	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、申报交易单元号，取值为 2	N2
发起方交易商	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4

代码				
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.5.4 报价申报撤单响应消息

Quote Status Report (RespText)	报价申报撤单响应

描述：

每一个报价申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。

此消息用于确定报价申报撤单

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AI=报价状态报告	
117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报撤单中的会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID	对于报价申报撤单成功响应，为原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的 QuoteID，其他情况取值为空。	C10
694	QuoteRespType	取值： 2=报价申报撤单响应	N1
297	QuoteStatus	报价状态，取值： 申报撤单成功响应=1， 申报撤单失败响应=8	C2
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 当报价状态不为 8 时，该字段取值为空 报价状态为 8 时，表示处理失败的理由，取值同 Remark 字段，为错误代码。	C50

4.5.5 成交申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	成交申报

描述：

市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行报价成交申报，对应申报接口流中的 ReqText

使用此消息的申报类型有确定报价点击成交、最优价成交、可转换成交、指定对手方报价申报、协议交易

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType=	

			D：成交申报	
11	ClOrdID		会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537	QuoteType		报价类别 1502 = 最优价成交申报 1503 = 点击成交申报 1504 = 可转换成交申报 1505 =协议交易申报 1507 = 指定对手方报价申报	N4
6133	QuoteRefID		交易所参考订单编号，只能为数字。在确定报价点击成交时放置对手方的报价订单编号，其他情况无意义	C10
48	SecurityID		证券代码	C6
54	Side		买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖 协议交易时填写交易商账号买卖方向	C1
581	AccountType		录入类型，取值有：1 表示客户，2 表示交易商。0 表示无意义。 赋值说明：协议交易申报时使用，其他业务无意义。	C1
44	Price		价格(净价)，单位：元，精度：3 位，有对手方订单时，与该订单价格一致 对于最优价申报，如果无限价，则输入 0	N10(3)
38	OrderQty		订单数量，单位：手 确定报价点击成交、最优价成交和可转换成交时为固定成交单位；	N10
664	ConfirmID		约定号,三位定长数字 在指定对手方报价、协议交易填写，其他情况无意义	N3
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员、申报交易单元号、投资者账户、对手方交易商代码。取值=6。	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号。赋值说明如下： 协议交易申报：自营席位、客户席位。 其他业务：发起方 PBU 代码	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为交易单元号	N4
投资者账户	448	PartyID	投资者帐户，赋值说明如下： 协议交易申报：发起方股东账户、客户股东账户 其他业务：发起方股东账户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为投资者帐户	N4
对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，填写 6 位交易员代码。 指定对手方填写 6 位交易员代码。 协议交易无意义。 点击成交无意义。 最优价成交无意义。 可转换成交无意义。	C6
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
对手方交易商代码	448	PartyID	对手方交易商代码，填写 3 位交易商代码。 最优价成交填写 3 位交易商代码，可以为空。 协议交易无意义。 点击成交无意义。	C3

			指定对手方无意义。 可转换成交无意义。	
	452	PartyRole	取 37，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易商代码	N4
58	Text		备注，通常填写联系方式，协议交易填写	C170

4.5.6 成交申报撤单消息

OrderCancel Request (reqtext	成交申报撤单

描述：

市场参与者使用 OrderCancel Request 消息进行成交申报撤单，对应申报接口流中的 ReqText 用到本消息的申报类型有协议交易申报、指定对手方报价申报。

可转换成交申报通过报价申报撤单消息进行撤单。

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= F：成交申报撤单	
11	ClOrdID		会员内部编号，指成交申报会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
41	OrigClOrdID		原始交易客户内部编号，指示被撤单订单的 ClOrdID	C10
537	QuoteType		报价类别 1506 = 协议交易申报撤销 1508 = 指定对手方报价申报撤销	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、申报交易单元号，取值=2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.5.7 成交申报响应/成交申报撤单响应消息

ExecutionReport (RespText)	成交申报响应/成交申报撤单响应

描述：

每一个成交申报记录或成交申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= 8：成交申报响应	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 申报成功时，该字段取值为空 申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.5.8 非交易申报/非交易撤单申报消息

DesignationInstruction (ReqText)	非交易申报/撤单申报
描述： 市场参与者使用 DesignationInstruction 消息进行非交易申报，对应申报接口流中的 ReqText	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	标准消息头	MsgType 取值为 U041	
117	QuoteID	会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537	QuoteType	报价类别 1509 =转托管申报 1510 =转托管申报撤销 1511 = 可交换债换股申报 1512 = 债券回售申报 1513 = 债券回售申报撤销 1514 = 创新创业债转股冻结申报 1515 = 创新创业债转股冻结申报撤销	N4
41	OrigClOrdID	原始交易会员内部编号，表示被撤单订单的 QuoteID。 转托管申报、可交换债换股申报、债券回售申报、创新创业债转股冻结申报时无意义。	C10
48	SecurityID	证券代码	C6
38	OrderQty	单位：手 转托管申报时填写转托管数量 可交换债转股申报时填写换股数量 债券回售申报时填写回售数量 创新创业转股冻结申报时填写转股数量 转托管撤销、债券回售申报撤销、创新创业债转股冻结申报撤销无意义。	N10
54	Side	买卖方向，1 表示买，2 表示卖。 转托管申报、可交换债换股申报、债券回售申报、创新创业转股冻结申报只能赋值卖。	C1

			转托管撤销、债券回售申报撤销、创新创业债转股冻结申报撤销时赋值卖。	
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、投资者账户、申报交易单元号、银行间托管账号，取值为 5	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号。 转托管撤销、债券回售申报撤销、创新创业债转股冻结申报撤销无意义。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户。 转托管撤销、债券回售申报撤销、创新创业债转股冻结申报撤销无意义。	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
银行间托管帐号	448	PartyID	银行间托管账号，填写 11 位银行间托管账号。 可交换债换股申报、债券回售申报、创新创业转股冻结申报、转托管撤销、债券回售申报撤销、创新创业债转股冻结申报撤销无意义。	C11
	452	PartyRole	取 28，表示当前 PartyID 的取值为银行间托管账号	N4

4.5.9 非交易申报响应/非交易撤单申报响应

DesignationReport (RespText)	**非交易申报响应/非交易撤单申报响应**

描述：

每一个非交易申报记录或非交易申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	标准消息头	MsgType= U042：非交易申报/撤单响应	
537	QuoteType	响应类别 1509 = 转托管申报 1510= 转托管申报撤单 1511 = 可交换债换股申报 1512 = 债券回售申报 1513 = 债券回售申报撤销 1514 = 创新创业债转股冻结申报 1515 = 创新创业债转股冻结申报撤销	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应转托管申报/撤单消息 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应	C1
102	CxlRejReas	非交易申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错	C50

	on	误处理 撤消成功时，该字段取值为空 撤消失败时，撤单请求拒绝的理由，取值同 Remark 字段	
103	OrdRejReason	非交易申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 ~~转托管~~非交易申报成功时，该字段取值为空 ~~转托管~~非交易申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.5.10 意向申报/意向申报撤单消息

IOI (reqtext)	意向申报消息/意向申报撤单消息

描述：

市场参与者使用 IOI 消息进行意向申报或撤单。

平台采用原始意向申报的会员内部编号和申报交易员作为撤单索引字段。

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType= 6：意向申报或意向申报撤单	
23		IOIID	会员内部编号，指意向申报或意向申报撤单会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537		QuoteType	报价类别 1516 = 现券意向申报 1517 = 现券意向申报撤单	N4
26		IOIRefID	撤单编号，意向申报撤单时填写被撤原订单的会员内部编号，意向申报时填空	C10
48		SecurityID	证券代码	C6
54		Side	买卖方向，1 表示买，2 表示卖 意向申报撤单时填写 0	C1
38		OrderQty	意向数量，单位：手 意向申报撤单时填写 0	N10
44		Price	意向价格(净价)，单位：元，精度：3 位 意向申报撤单时填写 0	N10(3)
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、发起方的交易员代码。取值为 2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.5.11 意向申报响应/意向申报撤单响应

QuoteStatusReport(resptext)	**意向申报响应/意向申报撤单响应**
描述： 同步确认消息流中的 resptext 字段数据。 每一个报价申报记录都分别有一个对应的响应消息。	

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AJ：报价申报响应	
537	QuoteType	响应类别 1516 = 现券意向申报 1517 = 现券意向申报撤单	N4
23	IOIID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息 IOIID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应	C1
102	CxlRejReason	意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 撤消成功时，该字段取值为空 撤消失败时，表示拒绝的理由	C50
103	OrdRejReason	意向申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 报价申报成功时，该字段取值为空 报价申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.6 现券询价类消息

4.6.1 询价申报/询价申报撤销消息

IOI (reqtext)	**询价申报消息**
描述： 请求及响应接口表中的 reqtext 字段数据。 市场参与者使用 IOI 消息进行询价申报和询价申报撤销。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= 6：询价申报/询价申报撤销	
23	IOIID	会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
26	IOIRefID	原始询价申报会员内部编号，指示被撤消订单的 IOIID，询价申报时填空	C10
537	QuoteType	报价类别 1518 =询价申报 1519 = 询价申报撤销	N4

48	SecurityID		证券代码	C6
54	Side		买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖，询价申报撤销时填 0	C1
38	OrderQty		数量，单位：手，询价申报撤销时填 0	N10
UndInstrmtGrp				
711		NoUnderlyings	询价接收方交易商个数 询价申报时最大为 5，最小为 1，可为一级交易商（做市商）与普通交易商，其中普通交易商最多只能有一家 询价申报撤销时填 1	N10
→	56	TargetCompID	询价接收方交易商代码，询价申报时填写，询价申报撤销时填空	C3
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户，取值为 4	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，询价申报时填写 5 位申报交易单元号，询价申报撤销时填空	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户，询价申报时填写询价发起方投资者账户，询价申报撤销时填空	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4

4.6.2 询价申报/询价申报撤销响应消息

QuoteResponse (resptext)	询价申报/询价申报撤销响应

描述：

同步确认消息流中的 resptext 字段数据。

每一个询价申报/询价申报撤销记录都分别有一个对应的响应消息。

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AJ：报价申报响应	
537	QuoteType	响应类别 1518 =询价申报 1519 =询价申报撤销	N4
23	IOIID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息 IOIID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应	C1
102	CxlRejReason	询价申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信	C50

		息，进行错误处理 撤消成功时，该字段取值为空 撤消失败时，表示拒绝的理由	
103	OrdRejReason	询价申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 报价申报成功时，该字段取值为空 报价申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.6.3 被询价方报价消息

Quote (reqtext)	**被询价方报价申报**

描述：

市场参与者使用 Quote 消息进行被询价方报价申报。

用到本消息的报价类别有被询价方报价新增、被询价方报价修改。

已使用本消息进行被询价方报价后，可通过被询价方报价修改对报价要素进行修改。

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= S：报价申报	
117	QuoteID		会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
537	QuoteType		报价类别 1520 =被询价方报价新增 1549 = 被询价方报价修改	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
54	Side		买卖方向，取值有：1 表示买，2 表示卖	C1
44	Price		价格(净价)，单位：元，精度：3 位。	N10(3)
664	ConfirmID		要约编号 取非公开报价行情中的要约编号	N10
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、申报交易单元号、投资者账户，取值为 4	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4

4.6.4 被询价方报价响应消息

QuoteResponse (resptext)	被询价方报价申报响应消息

描述：

响应接口流中的 resptext 字段数据。

每一个报价申报记录都分别有一个对应的响应消息。

市场参与者系统可以获得上交所处理报价申报后返回的确认信息。

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType 取值为：AJ=报价申报响应	
537	QuoteType	报价类别 1520 =被询价方报价新增 1549 = 被询价方报价修改	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息中的 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应	C1
103	OrdRejReason	报价请求报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 报价申报成功时，该字段取值为空 报价申报失败时，表示拒绝的理由，取值同 Remark 字段。	C50

4.6.5 被询价方报价撤销消息

QuoteCancel (reqtext)	被询价方报价撤销

描述：

市场参与者使用 QuoteCancel 消息进行被询价方报价撤销申报。

用到本消息的报价类别有被询价方报价撤销。

本消息使用被询价方报价申报时填写的要约编号进行撤销申报。

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= Z：报价申报撤销	
117	QuoteID		会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
537	QuoteType		报价类别 1521 = 被询价方报价撤销	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
664	ConfirmID		要约编号	N10
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码，取值为 2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商	N4

			代码	
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.6.6 被询价方报价撤销响应消息

Quote Status Report(resptext)	被询价方报价撤销响应消息
描述： 同步确认消息流中的 resptext 字段数据。 每一个被询价方报价撤销记录都分别有一个对应的响应消息。	

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AI=报价状态报告	
117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报撤单中的会员内部编号。	C10
664	ConfirmID	对于报价申报撤单成功响应，为被撤消订单的要约编号，其他情况取值为空。	C10
694	QuoteRespType	取值： 2=报价申报撤单响应	N1
297	QuoteStatus	报价状态，取值： 申报撤单成功响应=1， 申报撤单失败响应=8	C2
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 当报价状态不为 8 时，该字段取值为空 报价状态为 8 时，表示处理失败的理由，取值同 Remark 字段，为错误代码。	C50

4.6.7 询价成交申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	**询价成交申报**
描述： 市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行询价成交申报，对应申报接口流中的 ReqText 使用此消息的报价类别有询价成交申报	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= D：成交申报	
11	ClOrdID	会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全	C10

			为空格	
537	QuoteType		报价类别 1522 = 询价成交申报	N4
48	SecurityID		证券代码	C6
664	ConfirmID		要约编号 取非公开报价行情中的要约编号	N10
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码，取值=2。	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.6.8 询价成交申报响应消息

ExecutionReport (RespText)	**询价成交申报响应**
描述： 每一个成交申报记录或成交申报撤单记录都分别有一个对应的响应消息。 市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。	

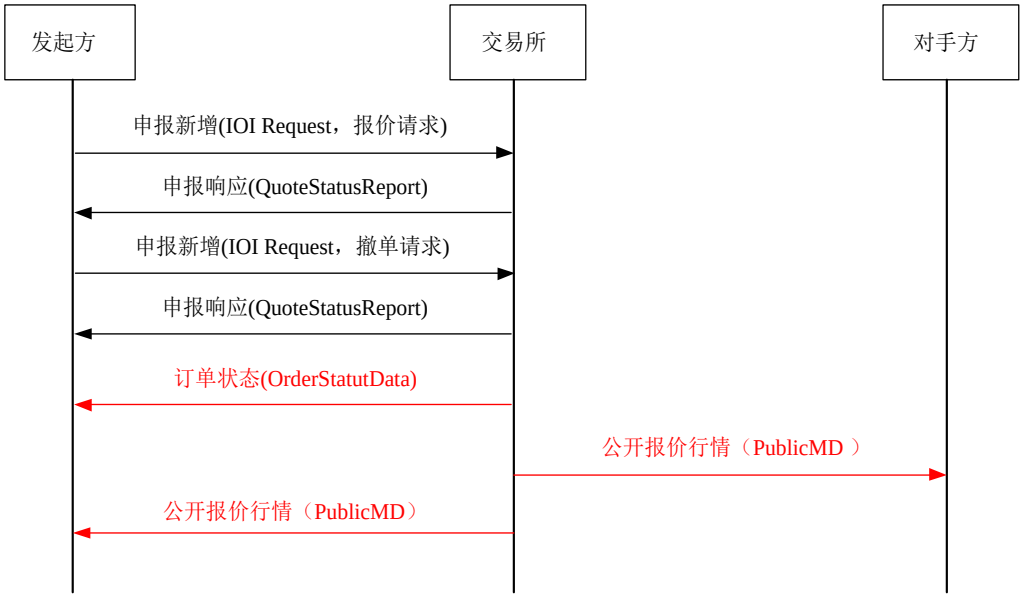
标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= 8：成交申报响应	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 申报成功时，该字段取值为空 申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.7 三方回购消息处理流程说明

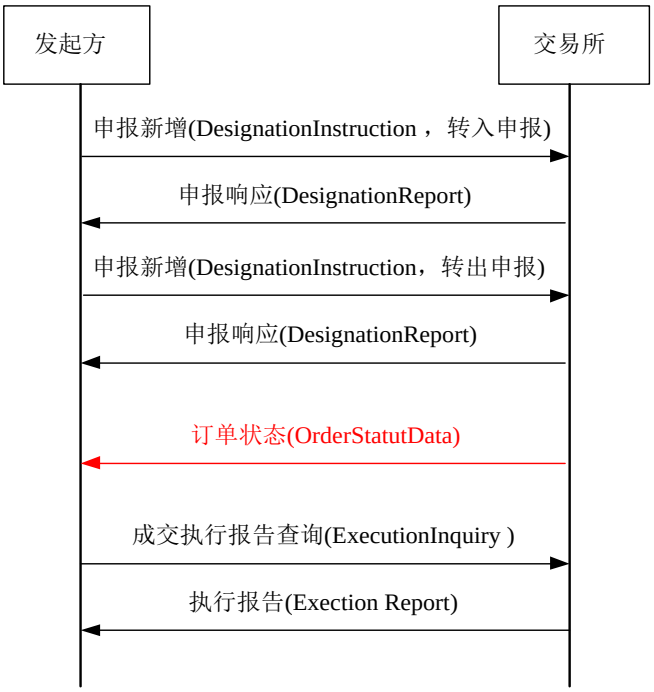
债券质押式三方回购（简称“三方回购”）是以债券为权利质押，第三方提供集中、专业的托管、结算和担保品管理服务的短期资金融通业务。第三方并不作为中央对手方，对手方违约风险仍由交易双方自行承担。在回购存续期间，正回购方的质押担保品托管在开立于中国结算的专用账户中，并接收质押券篮子管理。

三方回购业务功能包括意向申报、转入转出申报、指定对手方申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报、到期购回申报、补券申报。下图描述了意向申报、转入转出申报、指定对手方申报、到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报、到期购回申报、补券申报的 STEP 消息通信流程。

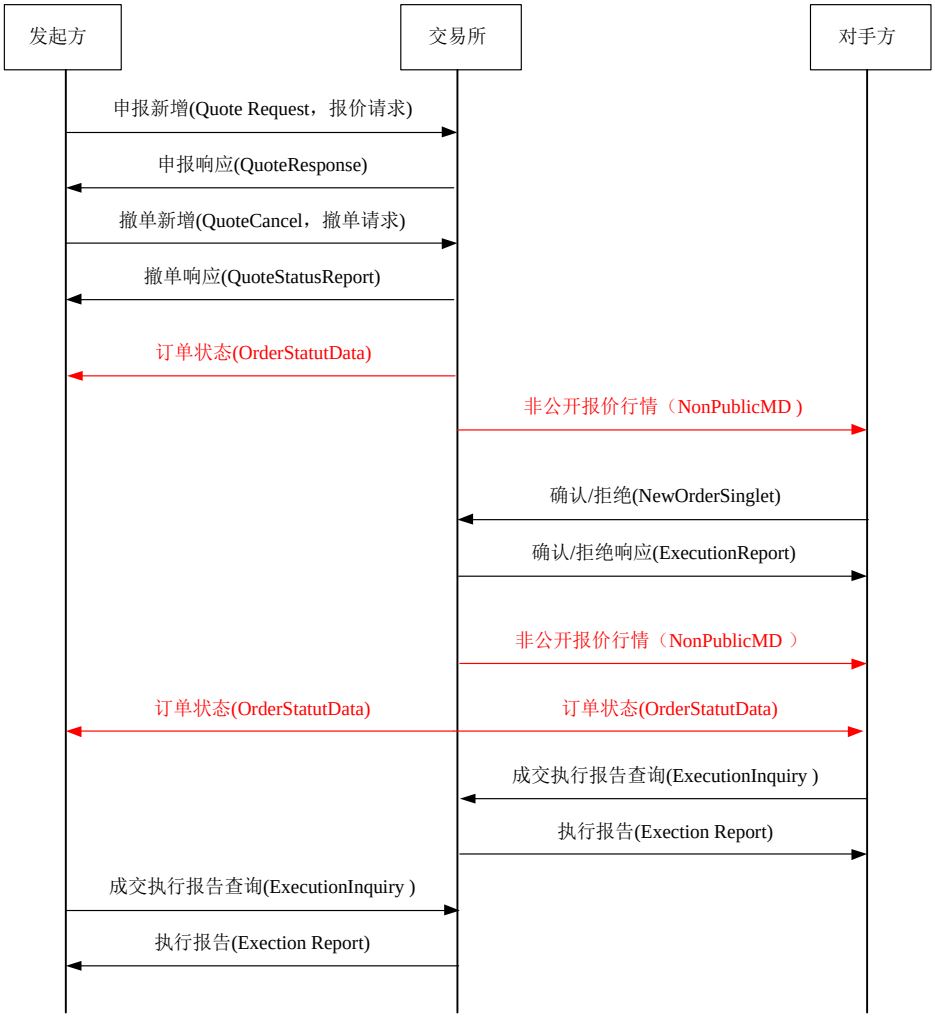
三方回购意向申报STEP消息流程



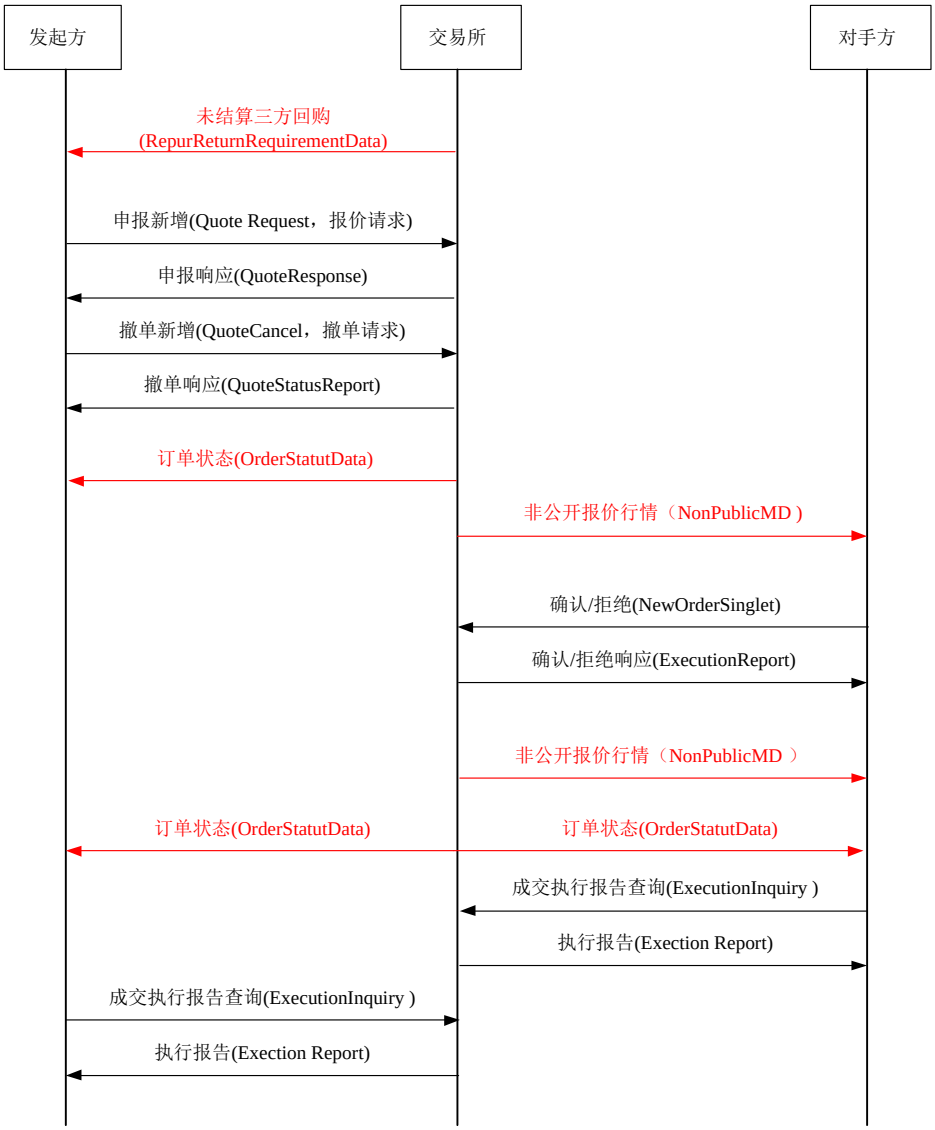
三方回购转入转出申报STEP消息流程



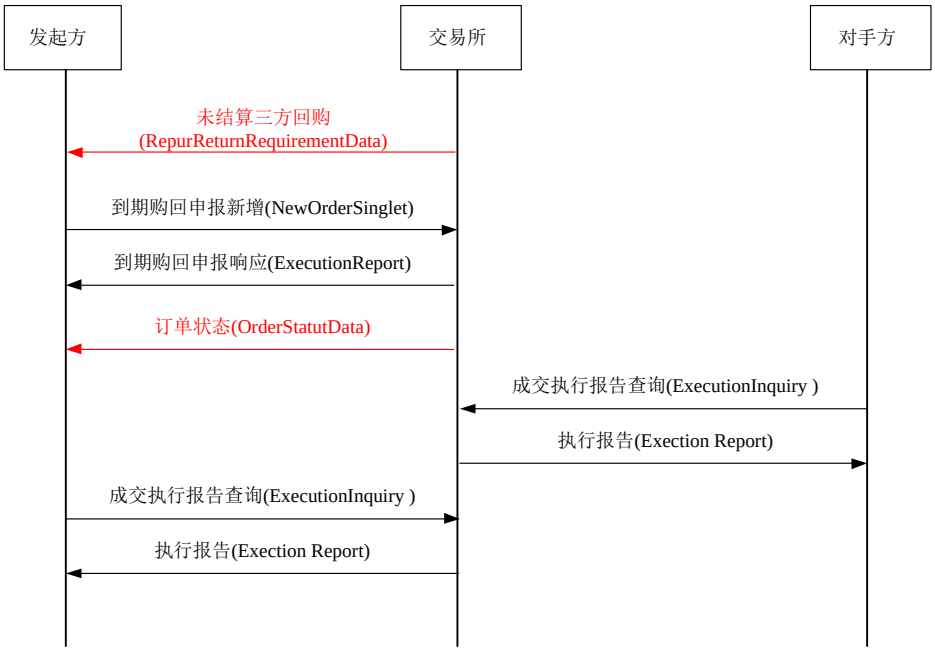
三方回购指定对手方申报STEP消息流程



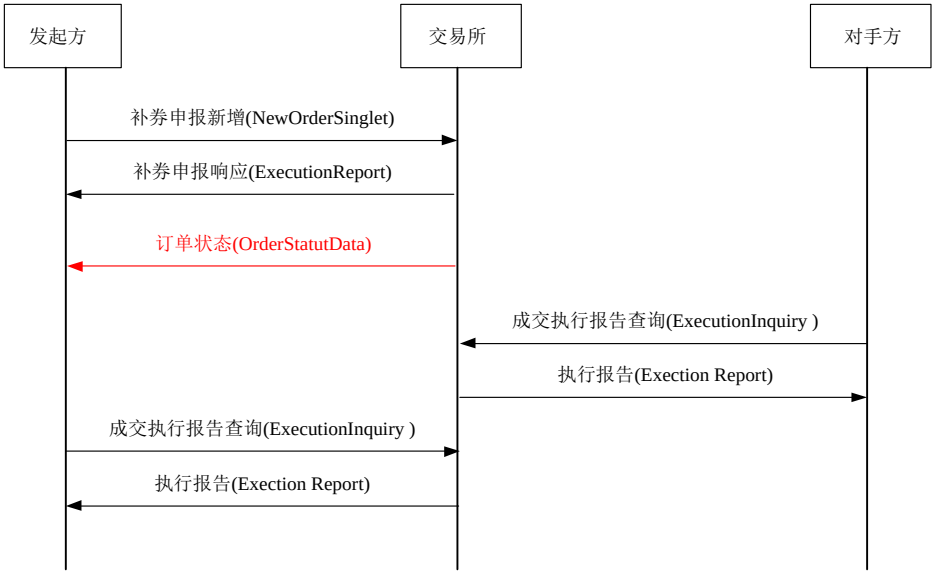
三方回购到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报STEP消息流程



三方回购到期购回申报STEP消息流程



三方回购补券申报STEP消息流程



4.8 三方回购订单类消息

4.8.1 意向申报/意向申报撤销消息

IOI (reqtext)	三方回购意向申报/意向申报撤销消息
描述： 市场参与者使用 IOI 消息进行三方回购意向申报/三方回购意向申报撤销。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType= 6：意向申报或意向申报撤单	
23		IOIID	会员内部编号，指三方回购意向申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
26		IOIRefID	撤单编号，三方回购意向申报撤单时填写被撤原订单的会员内部编号 三方回购意向申报时填空	C10
537		QuoteType	报价类别 1523 = 三方回购意向申报 1524 = 三方回购意向申报撤单	N4
54		Side	三方回购意向申报时填写回购方向，1 表示正回购，2 表示逆回购 三方回购意向申报撤销时填 0	C1
44		Price	三方回购意向申报时填写回购利率，单位：%，精度：3 位 三方回购意向申报撤销时填 0	N10(3)
226		RepurchaseTerm	三方回购意向申报时填写回购期限，以天计，1-365 天 三方回购意向申报撤销时填 0	N4
8504		TotalValueTraded	三方回购意向申报时填写成交金额，单位：元，必须为整数，且在区间(0,100000000000]内 三方回购意向申报撤销时填 0	N16(2)
BasketGrp				
8529		NoBaskets	质押券篮子个数 三方回购意向申报时最小为 1，最大为 8 三方回购意向申报撤销时填 0	N2
→	8530	Basket	质押券篮子，可填写值为： B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 三方回购意向申报撤销时无需提供该字段	C4
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、投资者账户、申报交易单元号、三方回购专用账户、三方回购专用账户对应交易单元号。取值为 6	N2

发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户。 三方回购意向申报时，若回购方向为逆回购，填写发起方普通账户。其他情况该字段无意义	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码 三方回购意向申报时，若回购方向为逆回购，则该字段填写 5 位发起方普通账户对应申报交易单元号。其他情况该字段无意义	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方三方回购专用账户	448	PartyID	三方回购意向申报时，若回购方向为正回购，填写发起方三方回购专用帐户。其他情况该字段无意义	C10
	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N4
发起方三方回购专户对应交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码 三方回购意向申报时，若回购方向为正回购，填写 5 位三方回购专用账户对应申报交易单元号。其他情况该字段无意义	C5
	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4

4.8.2 意向申报/意向申报撤销响应消息

QuoteStatusReport(resptext)	三方回购意向申报/意向申报撤销响应

描述：

同步确认消息流中的 resptext 字段数据。

每一个三方回购意向申报/意向申报撤销记录都分别有一个对应的响应消息。

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AJ：报价申报响应 或 报价请求及撤单响应 或 意向申报及撤单响应	
537	QuoteType	响应类别 1523 =三方回购意向申报 1524 =三方回购意向申报撤销	N4
23	IOIID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息 IOIID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应，6=撤单成功响应	C1
102	CxlRejReason	三方回购意向申报撤单错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 撤单成功时，该字段取值为空 撤单失败时，表示拒绝的理由	C50

103	OrdRejReason	三方回购意向申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 意向申报成功时，该字段取值为空 意向申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.8.3 转入转出申报

DesignationInstruction (ReqText)	三方回购转入/转出申报
描述： 市场参与者使用 DesignationInstruction 消息进行三方回购转入转出申报，对应申报接口流中的 ReqText	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		标准消息头	MsgType 取值为 U041	
117		QuoteID	会员内部编号，只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537		QuoteType	报价类别 1547 = 三方回购转入申报 1548 = 三方回购转出申报	N4
48		SecurityID	质押券代码	C6
38		OrderQty	质押券数量，单位：手	N10
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码、三方回购普通账户对应交易单元号、三方回购普通账户、三方回购专用账户对应交易单元号、三方回购专用账户，取值为 6	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位发起方普通账户对应申报交易单元号。	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户。填写发起方普通账户	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方三方回购专户对应交易单元号	448	PartyID	发起方三方回购专用账户对应交易单元号	C5
	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户对应交易单元号	N4
发起方三方回	448	PartyID	填写三方回购专用账户。	C10
	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购	N4

购专用账户			专用账户	

4.8.4 转入转出申报响应

DesignationReport (RespText)	三方回购转入/转出申报响应
描述： 每一个三方回购转入/转出申报记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	标准消息头	MsgType 取值为 U042	
537	QuoteType	响应类别 1547 = 三方回购转入申报 1548 = 三方回购转出申报	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应转托管申报消息 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应	C1
103	OrdRejReason	三方回购转入/转出申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 转入/转出申报成功时，该字段取值为空 转入/转出申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.8.5 报价申报消息

Quote (reqtext)	报价申报
描述：市场参与者使用 Quote 消息进行报价申报。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= S：报价申报	
117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537	QuoteType	报价类别 1525 = 三方回购指定对手方申报 1530 = 三方回购到期续做申报 1534 = 三方回购解除质押申报 1538 = 三方回购提前终止申报 1542 = 三方回购换券申报	N4
54	Side	买卖方向，三方回购报价申报时填写回购方向：1 表示正回购，2 表示逆回购	C1

		三方回购指定对手方申报、到期续做申报、提前终止申报、解除质押申报、换券申报时只能填写 1	
44	Price	回购利率，单位：%，精度：3 位 三方回购指定对手方申报填写回购利率 三方回购到期续做申报填写新回购利率 三方回购提前终止申报填写实际回购利率 三方回购解除质押申报、换券申报填写 0	N10(3)
226	RepurchaseTerm	回购期限，以天计，1-365 天 三方回购指定对手方申报填写回购期限 三方回购到期续做申报填写新回购期限 三方回购提前终止申报填写提前终止后回购期限 三方回购解除质押申报、换券申报填写 0	N4
64	SettlDate	首次结算日，格式为：YYYYMMDD 三方回购指定对手方申报、到期续做申报填写当前交易日 三方回购提前终止申报、解除质押申报、换券申报填空	C8
541	MaturityDate	回购到期日，格式为：YYYYMMDD 三方回购指定对手方申报填写回购到期日=首次结算日+回购期限 三方回购到期续做申报填写新回购到期日=新首次结算日+新回购期限 三方回购提前终止申报填写提前终止日期，为当前交易日 三方回购解除质押申报、换券申报填空	C8
8847	UAInterestAccrualDays	实际占款天数，以天计，1-365 天 三方回购指定对手方申报填写实际占款天数=回购到期日-首次结算日 三方回购到期续做申报填写新实际占款天数=新回购到期日-新首次结算日 三方回购提前终止申报填写提前终止后实际占款天数 三方回购解除质押申报、换券申报填写 0	N3
8504	TotalValueTraded	成交金额，单位：元；必须为整数，且在区间(0,100000000000]内 三方回购指定对手方申报填写成交金额 三方回购到期续做申报填写续做成交金额 三方回购解除质押申报、提前终止申报、换券申报填 0	N16
159	AccruedInterestAmt	回购利息，单位：元，精度：2 位，四舍五入 三方回购指定对手方申报填写回购利息=(成交金额*回购利率(%)*实际占款天数)/365 三方回购到期续做申报填写续做回购利息=(续做成交金额*续做回购利率(%)*新实际占款天数)/365	N12~~6~~(2)

			三方回购提前终止申报填写提前终止回购利息=(原成交金额*提前终止回购利率(%)*提前终止后实际占款天数)/365 三方回购解除质押申报、换券申报填 0	
119		SettlCurrAmt	到期结算金额，单位：元，精度：2 位，四舍五入 三方回购指定对手方申报填写到期结算金额=成交金额*(1+回购利率(%)*实际占款天数/365) 三方回购到期续做申报填写新到期结算金额=续做成交金额*(1+续做回购利率(%)*新实际占款天数/365) 三方回购提前终止填写提前终止结算金额=原成交金额*(1+提前终止回购利率(%)*提前终止后实际占款天数/365) 三方回购解除质押申报、换券申报填 0	N16(2)
529		OrderRestrictions	三方回购指定对手方申报时填写违约后是否进行担保品快速处置，Y 表示是，N 表示否 其他申报填空	C1
BasketGrp				
8529		NoBaskets	质押券篮子个数 三方回购指定对手方申报最小为 1，最大为 8 其他申报类型填 0	N2
→	8530	Basket	质押券篮子，可填写值为： B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 三方回购指定对手方申报时填写质押券篮子编号（如 B001） 其他申报类型时无需提供该字段	C4
UndInstrmtGrp				
711		NoUnderlyings	质押券个数 三方回购指定对手方申报为 0-3 三方回购换券申报为 2，两组重复组中操作标识必须分别为 21 和 22，分别表示换入质押券信息与换出质押券信息（若为仅换出，仍需填写 2，且操作标识为 21 的重复组中的，质押券数量填 0，质押券代码建议填写换出质押券代码） 其他报价类别为 0	N10
→	865	EventType	操作标识，20 表示指定对手方申报，21 表示换券申报换入，22 表示换券申报换出 三方回购指定对手方申报时若质押券个数为 0，无需提供该字段，若质押券个	N2

			数不为 0，则填写 20 三方回购换券申报时可填写 21 或 22 三方回购到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时无需提供该字段	
→	48	SecurityID	质押券代码 三方回购指定对手方申报时若质押券个数为 0，无需提供该字段，若质押券个数不为 0，填写质押券代码 三方回购换券申报时，若操作标志为 21，填写换入质押券代码，若操作标识为 22，填写换出质押券代码 三方回购到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时无需提供该字段	C6
→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手 三方回购指定对手方申报时若质押券个数为 0，无需提供该字段，若质押券个数不为 0，填写质押券数量 三方回购换券申报时，若操作标志为 21，填写换入质押券数量，若操作标识为 22，填写换出质押券数量 三方回购到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时无需提供该字段	N10
1125		OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期 三方回购到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，三方回购指定对手方申报时填空	C8
19		ExecRefID	成交申报时交易所成交编号，引用未结算三方协议回购数据中的成交编号 三方回购到期续做申报、解除质押申报、换券申报、提前终止申报时填写，三方回购指定对手方申报时填 0	N10
Parties				
453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方交易商代码、发起方的交易员代码、发起方三方回购专用账户交易单元、发起方三方回购专用账户、对手方交易员。取值为 5	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方三方回购专用账户交易单	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，填写 5 位申报交易单元号 三方回购指定对手方申报时，填写发起方三方回购专用账户交易单元 存续期申报时填写三方回购指定对手方时提供的三方回购专用账户交易单元。其他情况该字段无意义	C5

元	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户交易单元	N4
发起方三方回购专用账户	448	PartyID	发起方投资者帐户 三方回购指定对手方申报时，填写发起方三方回购专用账户 存续期申报时填写三方回购指定对手方申报时提供的三方回购专用账户。 其他情况该字段无意义	C10
	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方三方回购专用账户	N4
对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，填写 6 位交易员代码 存续期申报时填写的对手方交易员必须与三方回购指定对手方是填写的对手方交易员属于同一交易商（可以为同一个交易员）	C6
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
58		Text	补充条款	C170

4.8.6 报价申报响应消息

QuoteResponse (resptext)	报价申报响应消息

描述：

响应接口流中的 resptext 字段数据。

每一个报价申报记录都分别有一个对应的响应消息。

市场参与者系统可以获得上交所处理报价申报后返回的确认信息。

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType 取值为：AJ=报价申报响应 或 报价请求及撤单响应 或 意向申报及撤单响应。	
537	QuoteType	报价类别 1525 = 三方回购指定对手方申报 1530 = 三方回购到期续做申报 1534 = 三方回购解除质押申报 1538 = 三方回购提前终止申报 1542 = 三方回购换券申报	N4
117	QuoteID	会员内部编号，该字段对应报价申报消息中的 QuoteID	C10
150	ExecType	当前订单执行状态，取值有： 0=成功响应，8=拒绝响应	C1
103	OrdRejReason	报价请求报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 三方回购报价申报成功时，该字段取值为空 三方回购报价申报失败时，表示拒绝的理由，取值	C50

		同 Remark 字段。	

4.8.7 报价申报撤销消息

QuoteCancel (reqtext)	报价申报撤销
描述： 市场参与者使用 QuoteCancel 消息进行三方回购报价申报撤销。	

标签	字段名		字段描述	类型
9	消息长度		后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头		MsgType= Z：报价申报撤销	
117	QuoteID		会员内部编号，指报价申报会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID		原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的 QuoteID	C10
537	QuoteType		报价类别 1526 = 三方回购指定对手方申报撤销 1531 = 三方回购到期续做申报撤销 1535 = 三方回购解除质押申报撤销 1539 = 三方回购提前终止申报撤销 1543 = 三方回购换券申报撤销	N4
453	NoPartyIDs		发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、交易员代码，取值为 2	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4

4.8.8 报价申报撤销响应消息

Quote Status Report(resptext)	三方回购报价申报撤销响应消息
描述： 同步确认消息流中的 resptext 字段数据。 每一个三方回购报价申报撤销记录都分别有一个对应的响应消息。	

序号	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= AI=报价状态报告	

117	QuoteID	会员内部编号，指报价申报撤销报文中的会员内部编号。	C10
41	OrigClOrdID	对于报价申报撤单成功响应，为原始交易会员内部编号，指示被撤消订单的 QuoteID，其他情况取值为空。	C10
694	QuoteRespType	取值： 2=报价申报撤单响应	N1
297	QuoteStatus	报价状态，取值： 申报撤单成功响应=1， 申报撤单失败响应=8	C2
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理。 当报价状态不为 8 时，该字段取值为空 报价状态为 8 时，表示处理失败的理由，取值同 Remark 字段，为错误代码。	C50

4.8.9 成交申报消息

NewOrderSingle (reqtext)	**成交申报**
描述：市场参与者使用 NewOrderSingle 消息进行成交申报，对应申报接口流中的 ReqText	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= D：成交申报	
11	ClOrdID	会员内部编号，指报价申报会员内部编号。只允许数字、字母、空格，不能全为空格	C10
537	QuoteType	报价类别 1527 = 三方回购指定对手方申报确认 1528 = 三方回购指定对手方申报拒绝 1529 = 三方回购到期购回申报 1532 = 三方回购到期续做申报确认 1533 = 三方回购到期续做申报拒绝 1536 = 三方回购解除质押申报确认 1537 = 三方回购解除质押申报拒绝 1540 = 三方回购提前终止申报确认 1541 = 三方回购提前终止申报拒绝 1544 = 三方回购换券申报确认 1545 = 三方回购换券申报拒绝 1546 = 三方回购补券申报	N4
54	Side	买卖方向，三方回购成交申报时填写回购方向：1 表示正回购，2 表示逆回购 三方回购指定对手方申报确认、到期续做申报确认、解除质押申报确认、提前终止申报确认、换券申报确认时只能填 2 三方回购到期购回申报、补券申报时只能填 1 三方回购指定对手方申报拒绝、到期续做申报拒绝、解除质押申报拒绝、提前终止申报拒绝、换券申报拒绝时无意义，填写 0	C1

6133		QuoteRefID	交易所要约编号，只能为数字。 三方回购指定对手方申报确认/拒绝、到期续做申报确认/拒绝、解除质押申报确认/拒绝、提前终止申报确认/拒绝、换券申报确认/拒绝时填写 三方回购补券申报、到期购回申报填空	C10
BasketGrp				
8529		NoBaskets	质押券篮子个数 三方回购补券申报填 1 其他申报类型填 0	N2
→	8530	Basket	质押券篮子，可填写值为： B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 三方回购补券申报时填写新质押券所属篮子编号 其他申报类型时无需提供该字段	C4
UndInstrmtGrp				
711		NoUnderlyings	质押券个数 三方回购补券申报填 1 其他报价类别为 0	N10
→	865	EventType	操作标识：23 表示补券 三方回购补券申报时填写 23 其他报价类型无需提供该字段	N2
→	48	SecurityID	质押券代码 三方回购补券申报时填写补券用新质押券代码 其他报价类型无需提供该字段	C6
→	38	OrderQty	质押券数量，单位：手 三方回购补券申报时填写补券用新质押券数量 其他报价类型无需提供该字段	N10
1125		OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期 三方回购补券申报、到期购回申报、到期续做申报确认、解除质押申报确认、提前终止申报确认、换券申报确认时填写 三方回购指定对手方申报确认、三方回购指定对手方申报拒绝、到期续做申报拒绝、解除质押申报拒绝、提前终止申报拒绝、换券申报拒绝时填空	C8
19		ExecRefID	成交申报时交易所成交编号，引用未结算三方协议回购数据中的成交编号 三方回购补券申报、到期购回申报、到期续做申报确认、解除质押申报确认、提前终止申报确认、换券申报确认时填写 三方回购指定对手方申报确认、三方回购指定对手方申报拒绝、到期续做申报拒绝、解除质押申报拒绝、提前终止申报拒绝、换券申报拒绝时填 0	N10
Parties				

453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方交易商代码、发起方的交易员代码、发起方投资者账户、发起方申报交易单元号、发起方三方回购专用账户、发起方三方回购专户对应交易单元、质权人名称、对手方交易员。取值为 8	N2
发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
发起方申报交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
发起方投资者账户	448	PartyID	发起方投资者帐户。 三方回购指定对手方申报确认、到期续做申报确认、解除质押申报确认、提前终止申报确认、换券申报确认时填写发起方普通账户 其他申报类型填空	C10
	452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4
发起方申报交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码 三方回购指定对手方申报确认、到期续做申报确认、解除质押申报确认、提前终止申报确认、换券申报确认时填写发起方普通账户对应申报交易单元 其他申报类型填空	C5
	452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
发起方三方回购专用账户	448	PartyID	三方回购补券申报、到期购回申报时填写发起方三方回购专用帐户。其他情况该字段无意义	C10
	452	PartyRole	取 107，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者账户	N4
发起方三方回购专户对应交易单元号	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码 三方回购补券申报、到期购回申报时填写 5 位发起方三方回购专用账户对应申报交易单元号。其他情况该字段无意义	C5
	452	PartyRole	取 106，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
质权人名称	448	PartyID	质权人名称 三方回购指定对手方确认申报、到期续做申报确认时填写，其他申报类型时填空	C30
	452	PartyRole	取 105，表示当前 PartyID 的取值为质权人名称	N4
对手方交易员代码	448	PartyID	对手方交易员代码，填写 6 位交易员代码 三方回购补券申报、到期购回申报时填写 其他申报类型时填空	C6
	452	PartyRole	取 102，表示当前 PartyID 的取值为对手方的交易员代码	N4
58		Text	补充条款 三方回购补券申报、到期购回申报时填写，无补充条款时填空 其他申报类型时该字段无意义，填空	C170

4.8.10 成交申报响应消息

ExecutionReport (RespText)	成交申报响应
描述： 每一个成交申报记录都分别有一个对应的响应消息。市场参与者系统可以获得上交所处理申报后返回的确认信息。	

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType= 8：成交申报响应	
150	ExecType	当前订单执行类型，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
39	OrdStatus	当前订单状态，取值有： 0=成功响应 8=拒绝响应	C1
11	ClOrdID	会员内部编号	C10
103	OrdRejReason	申报错误信息，供柜台系统读取错误信息，进行错误处理 申报成功时，该字段取值为空 申报失败时，表示拒绝的理由	C50

4.9 执行报告查询类消息

4.9.1 成交执行报告查询

ExecutionInquiry (reqtext)	成交执行报告查询
描述： 市场参与者查询成交执行报告。	

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType 取值为 U023	
1346		ApplReqID	查询请求编号	N10
537		QuoteType	申请类别 3139 －查询成交执行报告	N4
7		BeginSeqNo	起始成交序号，单调递增不连续，最小值为 0，最大值为 1000000000	N10
453		NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，查询方方交易商代码,交易员代码	N2
查询方交易商	448	PartyID	查询方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为查询方	N4

代码			的交易商代码	
查询方交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易员代码	N4

4.9.2 成交执行报告响应

ExecutionReport (reqtext)	**成交执行报告响应**

描述：

响应市场参与者成交执行报告查询。

一次查询最多返回自查询起始序号起 1000 条记录。

若查询结果无数据，响应消息报文截止到 16(EndSeqNo)字段。

成交执行报告响应包含现券确定报价、现券指定对手方、协议交易、应急成交、询价、协议回购、三方回购与。转托管、可交换债换股、债券回售、创新创业债转股等非交易类请查询过户数据（zghxxx），详见 5.1。

对债券质押式协议回购到期续做，**会同时生成一笔合约了结和一笔合约新开的成交信息**，其中业务子类型为 614：债券质押式协议回购到期续做前期合约了结的记录的会员内部编号为空，业务子类型为 615：债券质押式协议回购到期续做合约新开的记录的会员内部编号有值。两笔记录交易所订单编号不同，成交编号不同。

对债券质押式三方回购到期续做，**会同时生成一笔合约了结和一笔合约新开的成交信息**，其中业务子类型为 689：债券质押式三方回购到期续做合约了结的记录的会员内部编号为空，业务类型为 682：债券质押式三方回购到期续做合约新开的记录的会员内部编号有值。两笔记录交易所订单编号不同，成交编号不同。

对债券质押式三方回购转入申报、债券质押式三方回购转出申报，**会同时对转入账户与转出账户各生成一笔成交信息**，会员内部编号相同，交易所订单编号不同，成交编号相同。

对于符合以下条件的记录，会员内部编号为空：

1、 该笔成交申报对应本方申报未通过 EzDA 申报

2、 业务子类型为 614：债券质押式协议回购到期续做前期合约了结

3、 业务子类型为 689：债券质押式三方回购到期续做合约了结

4、 业务子类型为 681：债券质押式三方回购到期购回 且 查询方为逆回购方

5、 业务子类型为 613：债券质押式协议回购到期确认 且 查询方为逆回购方

6、 业务子类型为 687：债券质押式三方回购补券申报 且 查询方为逆回购方

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35	消息头	MsgType=	

			U024：执行报告	
1346		ApplReqID	查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的ApplReqID	N10
16		EndSeqNo	此次查询结束成交序号（全市场）	N10
146		NoRelatedSym	记录笔数	N10
→	11	ClOrdID	会员内部编号，该字段为空的的场景参见上表中的描述。	C10
→	37	OrderID	交易所订单编号	C16
→	17	ExecID	成交编号	N10
→	1125	OrigTradeDate	成交申报时交易所成交日期 对于债券质押式协议回购到期确认 债券质押式协议回购到期续做前期合约了结 债券质押式协议回购到期续做合约新开 债券质押式协议回购换券申报 债券质押式协议回购提前终止 债券质押式协议回购解除质押 债券质押式三方回购到期购回 债券质押式三方回购到期续做合约新开 债券质押式三方回购提前终止 债券质押式三方回购换券申报 债券质押式三方回购补券申报 债券质押式三方回购解除质押 债券质押式三方回购到期续做合约了结有效 对于其他业务无效	C8
→	19	ExecRefID	成交申报时交易所成交编号 对于债券质押式协议回购到期确认 债券质押式协议回购到期续做前期合约了结 债券质押式协议回购到期续做合约新开 债券质押式协议回购换券申报 债券质押式协议回购提前终止 债券质押式协议回购解除质押 债券质押式三方回购到期购回 债券质押式三方回购到期续做合约新开 债券质押式三方回购提前终止 债券质押式三方回购换券申报 债券质押式三方回购补券申报 债券质押式三方回购解除质押 债券质押式三方回购到期续做合约了结 有效 对于其他业务无效	N10
→	828	TrdType	业务类别 01 场内现券（现券确定报价成交、指定对手方成交、询价成交） 02 场外现券（协议交易） 08 债券质押式协议回购 11 债券质押式三方回购	C2
→	48	SecurityID	证券代码 对协议回购，为质押券现券代码 对三方回购转入、转出，为质押券现券代码 对三方回购其他业务，为回购代码	C6
→	55	Symbol	证券简称 对协议回购，为质押券现券简称 对三方回购转入、转出，为质押券现券简称 对三方回购其他业务，为空	C8
→	1180	ApplID	对于质押式协议回购，含义为业务子类型，取值如	C11

			下： '619':债券质押式协议回购成交申报 '613':债券质押式协议回购到期确认 '614':债券质押式协议回购到期续做前期合约了结 '615':债券质押式协议回购到期续做合约新开 '616':债券质押式协议回购换券申报 '617':债券质押式协议回购提前终止 '618':债券质押式协议回购解除质押 对三方回购，含义为业务子类型，取值如下： '680':债券质押式三方回购指定对手方 '681':债券质押式三方回购到期购回 '682':债券质押式三方回购到期续做合约新开 '683':债券质押式三方回购提前终止 '684':债券质押式三方回购转入申报 '685':债券质押式三方回购转出申报 '686':债券质押式三方回购换券申报 '687':债券质押式三方回购补券申报 '688':债券质押式三方回购解除质押 '689':债券质押式三方回购到期续做合约了结 对于其他业务无效	
→	31	LastPx	价格，单位：元 对于质押式协议回购、三方回购，代表回购利率，只填写%左边的数值，省略%，例如：现实中的3.456%在此字段中填写3.456	N11(3)
→	32	LastQty	该笔成交数量， 单位：手 对债券质押式协议回购：成交申报和换券申报时填写质押数量，到期确认、到期续做前期合约了结、到期续做合约新开、解除质押、提前终止时填0 对三方回购：转入申报、转出申报、换券申报、补券申报时填写数量，其他填0	N12
→	882	UnderlyingDirtyPrice	参考全价价格。 对债券质押式协议回购、三方回购无效，填0	N11(3)
→	159	AccruedInterestAmt	参考应计利息 对场内现券、场外现券，最多保留8位小数 对债券质押式协议回购、三方回购无效，填0	N12(8)
→	236	Yield	参考到期收益率。单位：% 对债券质押式协议回购，为折算比例（百分比，精确到小数点后2位），只填写%左边的数值，省略%，最右两位填00，例如：现实中的95.27%填写95.2700） 对三方回购无效，填0	N10(4)
→	8504	TotalValueTraded	参考净价成交金额，单位：万元 对债券质押式协议回购无效；	N16(3)
→	119	SettlCurrAmt	参考全价成交金额，单位：万元 对债券质押式协议回购、三方回购为回购利息，单位：元	N16(2)
→	54	Side	买卖方向，取值有：1表示买，2表示卖 对于协议回购:1为正回购，2为逆回购 对三方回购转入：1表示投资者账户字段为三方回购专户，2表示投资者账户字段为普通账户 对三方回购转出：1表示投资者账户字段为普通账户，2表示投资者账户字段为三方回购专户 对三方回购其他业务：1为正回购，2为逆回购	C1

→	60		TransactTime	成交时间，格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
→	42		OrigTime	原有订单请求接收的时间,格式为 YYYYMMDD-HH:MM:SS.000	C21
→	BasketGrp				
→	8529		NoBaskets	质押券篮子个数 对债券质押式三方回购指定对手方，为质押券篮子个数 对其他业务无效，无该字段	N2
→	→	8530	Basket	质押券篮子，可填写值为： B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 对债券质押式三方回购指定对手方，为质押券篮子编号 对其他业务无效，无该字段	C4
→	Parties				
→	453		NoPartyIDs	发起方重复组，依次包含发起方的交易商代码、投资者账户、申报交易单元号。取值=4	N2
→	发起方交易商代码	448	PartyID	发起方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
		452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易商代码	N4
→	发起方交易员代码	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
		452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为发起方的交易员代码	N4
→	发起方申报 PBU 代码	448	PartyID	发起方申报 PBU 代码，为 5 位申报交易单元号。	C5
		452	PartyRole	取 1，表示当前 PartyID 的取值为申报交易单元号	N4
→	发起方投资者帐户	448	PartyID	发起方投资者帐户	C10
		452	PartyRole	取 5，表示当前 PartyID 的取值为发起方投资者帐户	N4

4.9.3 报价状态变更查询

OrderStatusChangeInquiry（reqtext）	**报价状态变更查询**

描述：

市场参与者查询报价状态变更。

目前响应内容为质押式协议回购意向申报及报价申报对手方拒绝后/本方撤单后，本方订单状态变更信息

标签	字段名	字段描述	类型
9	消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	

35		消息头	MsgType 取值为 U029	
1346		ApplReqID	查询请求编号	N10
537		QuoteType	申请类别 3164 一查询报价状态变更	N4
7		BeginSeqNo	起始序号，单调递增不连续，最小值为 0，最大值为 1000000000	N10
453		NoPartyIDs	参与方个数，取值=2，查询方方交易商代码,交易员代码	N2
查询方交易商代码	448	PartyID	查询方交易商代码，填写 3 位 CompanyID	C3
	452	PartyRole	取 12，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易商代码	N4
查询方交易员号	448	PartyID	交易员代码，填写 6 位交易员代码	C6
	452	PartyRole	取 101，表示当前 PartyID 的取值为查询方的交易员代码	N4

4.9.4 报价状态变更响应

OrderStatusChangeReport (reqtext)	**报价状态变更响应**

描述：

响应市场参与者报价状态变更查询。

一次查询最多返回自查询起始序号起 1000 条记录。

若查询结果无数据，响应消息报文截止到 16(EndSeqNo)字段。

标签		字段名	字段描述	类型
9		消息长度	后续数据的字节数，不包含自身	
35		消息头	MsgType= U030：报价状态变更通知	
1346		ApplReqID	查询请求编号，该字段对应查询请求消息中的 ApplReqID	N10
16		EndSeqNo	此次查询结束报价编号（全市场）	N10
146		NoRelatedSym	记录笔数	N10
→	37	OrderID	交易所订单编号	C16
→	11	ClOrdID	会员内部编号，该笔订单所对应的原始客户内部编号	C10
→	297	QuoteStatus	报价状态，取值： 对手方拒绝=5 本方撤单=6	C2

5 落地文件

5.1 总览

➢ 定时刷新的数据文件如下：

数据类型	文件名称	说明	定时刷新默认间隔（可配置）
确定报价	ZQ_QDBJ**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	5 秒
成交行情	ZQ_CJHQ**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	5 秒
成交明细	ZQ_CJMX**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	5 秒
证券信息	ZQ_ZQXX**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	5 分钟
过户数据	zgh**xxx**.txt	**xxx** 为该交易商代码	10 秒
公开报价行情	ZQ_GKBJ**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	10 秒
非公开报价行情	ZQ_FGKBJ**xxxxxx**.txt	**xxxxxx** 为该交易员代码	10 秒
订单状态	ZQ_DDZT**xxxxxx**.txt	**xxxxxx** 为该交易员代码	5 秒
未结算协议回购/三方回购	ZQ_WJS**xxx**.txt	**xxx** 为该交易商代码	5 分钟

➢ 非定时刷新的数据文件如下：

数据类型	文件名称	说明	落地时间
过户数据	zgh**xxx**.dbf	**xxx** 为该交易商代码	1. 系统状态：收盘 2. 界面发起
三方回购质押券所属篮子信息	ZQ_SFHGLZXX**yyyymmdd**.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	1. EzDA 启动后 2. 界面发起
债券是否非担保信息	ZQ_SFFDBXXyyyymmdd.txt	**yyyymmdd** 为当前日期	1. EzDA 启动后 ~~1.~~2. 界面发起

➢ **确定报价、成交行情、成交明细、证券信息、过户数据**的文件格式参见《IS109 固定收益平台外部数据接口规范》。

5.2 公开报价行情

PublicMD	**公开报价行情**

描述：

公开报价行情文件每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的文件，首次刷新时采用全量（仅包含公开报价行情当前状态，不包含历史状态）刷新方式，之后采用**增量方式**，在文件末尾新增行情记录。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

该文件必须以只读方式打开读取，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的自动刷新。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，无效字段使用空格填充，字段之间采用竖线

PublicMD	公开报价行情

（|）分隔。

公开报价行情落地文件包含现券意向申报、协议回购意向申报和三方回购意向申报信息。现券确定报价行情见确定报价落地文件。

序号	字段名	数据类型	长度	小数	格式
1	类型	TEXT	3		001：现券意向 301：协议回购意向 401：三方回购意向
2	行情更新类型	TEXT	1		0：新增 2：删除
3	订单号	NUMBER	10		交易所订单编号
4	报价方	TEXT	10		报价方名称
5	交易员	TEXT	6		报价方交易员代码
6	债券代码	TEXT	6		对现券意向，为债券代码 对协议回购意向，为质押券代码 三方回购意向时无效
7	债券简称	TEXT	30		对现券意向，为债券简称 对协议回购意向，为质押券简称 三方回购意向时无效
8	买卖方向	TEXT	1		1：买/正回购 2：卖/逆回购 对现券意向，为买卖方向 对协议回购意向、三方回购意向，为回购方向
9	价格	NUMBER	10	3	对现券意向，为价格，单位：元 对协议回购意向、三方回购意向，为回购利率，单位：%，精确到%小数点后 3 位。例如：现实中 3.456%在此字段应填 3.456
10	数量	NUMBER	10		单位：手 对现券意向，为数量 对协议回购意向，为质押数量 三方回购意向时无效
11	折算比例	NUMBER	6	2	对协议回购意向，为折算比例，单位：%，精确到%小数点后 2 位。例如：现实中 3.45%在此字段应填 3.45 现券意向、三方回购意向时无效
12	回购期限	TEXT	3		单位：天 对协议回购意向、三方回购意向，为回购期限 现券意向时无效
13	首次成交金额	NUMBER	16	2	单位：元 对协议回购意向、三方回购意向，为首次结算金额 现券意向时无效
14	结算日期	TEXT	8		对现券意向，为结算日期 对协议回购意向，为首次结算日，

					格式 YYYYMMDD 三方回购意向时无效
15	篮子信息	TEXT	10		B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 对三方回购意向，为篮子信息。右对齐，由 8 位 1、0 数字组成，代表第 1 号至第 8 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填写“11001000” 现券意向、协议回购意向时无效
16	投资者名称	TEXT	30		对三方回购意向，为投资者名称 现券意向、协议回购意向时无效
17	联系方式	TEXT	120		对三方回购意向，为投资者联系方式 现券意向、协议回购意向时无效
18	报价来源	TEXT	2		对三方回购意向，为报价来源 现券意向、协议回购意向时无效
19	中债代码	TEXT	30		对现券意向，为中债代码 协议回购意向、三方回购意向时无效
20	中债简称	TEXT	35		对现券意向，为中债简称 协议回购意向、三方回购意向时无效
21	结算场所	TEXT	1		对现券意向，为结算场所： 1：中国结算 2：中央结算 协议回购意向、三方回购意向时无效
22	结算速度	TEXT	1		对现券意向，为结算速度： 0：T+0 1：T+1 协议回购意向、三方回购意向时无效
23	价格类型	TEXT	1		对现券意向，为价格类型： 1：净价 2：全价 协议回购意向、三方回购意向时无效

5.3 非公开报价行情

NonPublicMD	**非公开报价行情**
描述： 非公开报价行情文件每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的文件，首次刷新时采用全量（仅包含非公开报价行情当前状态，不包含历史状态）刷新方式，之后采用**增量方**	

NonPublicMD	非公开报价行情

式，在文件末尾新增行情记录。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

该文件必须以只读方式打开读取，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的自动刷新。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录各字段（除债券明细字段）的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，无效字段使用空格填充，字段之间采用竖线（|）分隔。

对询价、被询价行情，类型表示接收方角色为询价方、被询价方。对其他行情，类型表示行情类型。

类型为询价、被询价时，对询价方能收到本方询价、被询价报价信息，对被询价方能收到询价方询价、本方报价信息：

询价方发起询价申报时，询价方能收到一笔或多笔（取决于被询价方个数）行情更新类型为 0（新增）的类型为询价的行情（简称询价行情，下同），被询价方能收到一笔行情更新类型为 0（新增）的类型为被询价的行情（简称被询价行情，下同），此时若被询价方发起被询价方报价新增，应使用该行情信息中的要约编号。

询价方发起撤销时，询价方能收到一笔或多笔（取决于被询价方个数）行情更新类型为 2（删除）的询价行情，被询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）的被询价行情。

被询价方发起被询价方报价新增时，询价方能收到一笔行情更新类型为 1（修改）的询价行情，被询价方能收到一笔行情更新类型为 1（修改）的被询价行情。

被询价方发起被询价方报价修改时，询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）、要约号为原要约号的询价行情和一笔行情更新类型为 1（修改）、要约号为新要约号的询价行情，被询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）、要约号为原要约号的被询价行情和一笔行情更新类型为 1（修改）、要约号为新要约号的被询价行情。此时若询价方发起询价成交申报、被询价方发起被询价方报价修改或撤销，应使用新要约编号作为要约编号。

被询价方发起被询价方报价撤销时，询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）的询价行情，被询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）的被询价行情。

询价方发起询价成交申报时，询价方能收到一笔或多笔（取决于被询价方个数）行情更新类型为 2（删除）的询价行情，被询价方能收到一笔行情更新类型为 2（删除）的被询价行情。

行情更新类型为删除时，除字段序号为 1、2、4 的三个字段外，其余字段均无效，为空。

序号	字段名	数据类型	长度	小数	格式
1	类型	TEXT	3		203：询价 204：被询价 302：协议回购首次申报 304：协议回购到期续做 305：协议回购解除质押 306：协议回购换券 307：协议回购提前终止 402：三方回购指定对手方 404：三方回购到期续做 405：三方回购解除质押 406：三方回购换券申报 407：三方回购提前终止
2	行情更新类型	TEXT	1		0：新增 1：修改 2：删除
3	订单编号	NUMBER	10		交易所订单编号 被询价(204)时无效
4	要约号	NUMBER	10		交易所要约号
5	状态	TEXT	1		对协议回购到期续做新增，为到期续做类型：N 非第三方续做，Y 第三方续做 对三方回购指定对手方新增和三方回购到期续做新增，为违约后是否进行快速处置：N 否，Y 是 协议回购、三方回购其他类型时无效 其他行情类型时无效
6	报价方	TEXT	10		对协议回购、三方回购，为报价方交易商简称 对被询价(204)，为询价方交易商简称 对询价(203)时无效
7	交易员	TEXT	6		对协议回购、三方回购，为报价方交易员代码 对询价(203)、被询价(204)时无效
8	买卖方向	TEXT	1		1：买/正回购 2：卖/逆回购 对询价(203)、被询价(204)，为询价方的买卖方向 对协议回购、三方回购，为回购方向
9	价格	NUMBER	10	3	对询价(203)、被询价(204)为价格，单位：元，被询价方未报价时为空 对协议回购、三方回购，为回购利率，单位：%，精确到%小数点后 3 位。例如：现实中 3.456%在此字段应填 3.456
10	回购期限	TEXT	3		单位：天 对协议回购、三方回购，为回购期限 其他行情类型时无效
11	首次结算日	TEXT	8		对询价(203)、被询价(204)，为询价

					时间，右对齐，后六位有效，格式 HHmmss，例如 112012 对协议回购、三方回购，为首次交收日，格式 YYYYMMDD 其他行情类型时无效
12	回购到期日	TEXT	8		对协议回购、三方回购，为回购到期日，格式 YYYYMMDD 其他行情类型时无效
13	到期结算日	TEXT	8		对协议回购、三方回购，为到期结算日，格式 YYYYMMDD 其他行情类型时无效
14	提前终止日期	TEXT	8		对协议回购提前终止、三方回购提前终止，格式 YYYYMMDD 其他行情类型时无效
15	实际占款天数	NUMBER	3		单位：天 对协议回购、三方回购，为实际占款天数 其他行情类型时无效
16	原成交日期	TEXT	8		对协议回购存续期申报行情、三方回购存续期申报行情，为对应成交申报时成交日期成交日期，格式 YYYYMMDD 其他行情类型时无效
17	原成交编号	NUMBER	10		对协议回购存续期申报行情、三方回购存续期申报行情，为对应成交申报时交易所成交编号 其他行情类型时无效
18	篮子信息	TEXT	10		B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 对三方回购，为篮子信息。右对齐，由 8 位 1、0 数字组成，代表第 1 号至第 8 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填写“11001000” 其他行情类型时无效
19	证券账户	TEXT	10		对协议回购存续期申报、三方回购存续期申报，为成交申报时本方证券账户 其他行情类型时无效
20	交易单元	TEXT	5		对协议回购存续期申报、三方回购存续期申报，为成交申报时本方证券账户对应交易单元 其他行情类型时无效
21	正回购方证券账户名称	TEXT	30		对协议回购首次申报、到期续做，为正回购方投资账户名称； 对三方回购指定对手方、到期续做，为正回购方证券账号名称；

					其他行情类型时无效
22	正回购方投资者名称	TEXT	30		对三方回购指定对手方、到期续做，为正回购方投资者名称； 其他行情类型时无效
23	逆回购方证券账户名称	TEXT	30		对三方回购到期续做，为原首次申报时逆回购方证券账号名称； 对三方回购解除质押、提前终止为逆回购方证券账户名称； 其他行情类型时无效
24	逆回购方投资者名称	TEXT	30		对三方回购到期续做，为原首次申报时逆回购方投资者名称； 对三方回购解除质押、提前终止为逆回购方投资者名称； 其他行情类型时无效
25	质权人名称	TEXT	30		对三方回购到期续做，为原首次成交逆回购方质权人名称 其他行情类型时无效
26	产品委托人	TEXT	30		对三方回购，为产品委托人 三方回购换券申报时无效 其他行情类型时无效
27	三方回购成交金额	NUMBER	16	2	单位：元 对三方回购，为回购金额 其他行情类型时无效
28	三方回购到期结算金额	NUMBER	16	2	单位：元 对三方回购，为到期结算金额 其他行情类型时无效
29	三方回购应计利息	NUMBER	126	2	单位：元 对三方回购，为应计利息 其他行情类型时无效
30	三方回购质押券合计担保价值	NUMBER	16	3	单位：元 对三方回购到期续做，为质押券合计担保价值 对三方回购换券申报，为原质押券合计担保价值 其他行情类型时无效
31	杠杆运作限制	TEXT	120		对三方回购，为杠杆运作限制 三方回购换券申报时无效 其他行情类型时无效
32	扩展信息	TEXT	170		对协议回购、三方回购，为补充条款询价(203)、被询价(204)时：中债代码（30 位，左补空）+中债简称（22 位，左补空）+结算场所（1 位）（1：中国结算 2：中央结算）+结算速度（1 位）（0：T+01：T+1）+价格类型（1 位）（1：净价 2：全价）+结算日期（8 位，YYYYMMDD）+空格（107 位）
33	债券明细	TEXT	变长		`*为分隔符，每组债券明细信息间各个字段以`分隔，以*结束 ● 询价(203)、被询价(204)时：债券代码`债券数量（单位：手，下同）*

					● 协议回购首次申报时：质押券代码`债券数量`折算比例（单位：%，精确到%小数点后 2 位。例如：现实中 3.45%在此字段应填 3.45，下同）`首次结算金额（单位：元）`应计利息（单位：元）`到期结算金额（单位：元）`质押券面值总额（单位：元）* ● 协议回购换券申报时：新质押券代码`新质押券数量`折算比例`首次结算金额`到期结算金额`应计利息`新质押券面值总额`原质押券代码`原成交金额（单位：元）* ● 协议回购其他申报时：债券代码`债券数量`折算比例`首次结算金额`到期结算金额`应计利息* ● 三方回购指定对手方申报时：质押券代码`质押券简称`质押券数量`质押券全价估值`质押券担保价值* ● 三方回购换券申报时：新质押券代码`新质押券数量`原质押券代码`原质押券数量* ● 三方回购到期续做申报、解除质押申报、提前终止申报时为空

5.4 订单状态

OrderStatusData	**订单状态**

描述：

每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的订单状态文件，刷新时采用**全量刷新**方式。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

该文件必须以只读方式打开读取，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的自动刷新。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

订单状态落地文件对满足以下任一条件的订单落地订单记录或变更订单记录：

1、 **该笔订单由当前交易员（简称本方，下同）通过 EzDA 发起，并且在固收平台生成订单。撤单、拒绝不在固收平台生成订单。在交易端发起的申报的订单不会落地。**

OrderStatusData	订单状态

2、 该笔订单由当前交易员通过 EzDA 发起且在固定收益平台生成订单的前提下（即订单状态落地文件中已有该笔订单的记录的前提下），订单状态发生变更（包括本方撤单、对手方确认、对手方拒绝，可通过 EzDA 或交易端发起）。

本方发起意向申报（现券意向、协议回购意向、三方回购意向）、报价申报（现券确定报价、协议回购首次/到期续做/解除质押/换券/提前终止、三方回购指定对手方/到期续做/解除质押/换券/提前终止）、成交申报（现券点击成交、现券最优价成交、现券可转成交、现券协议交易、现券指定对手方、协议回购到期确认、协议回购各报价申报确认、三方回购到期购回、三方回购各报价申报确认、三方回购补券）、非交易（转托管、可交换债换股、债券回售、创新创业债转股冻结）、询价申报、被询价方报价申报时会新增一笔订单记录。会员内部编号为申报时提供的会员内部编号。订单编号由固定收益平台生成。

本方发起撤单申报，仅变更对应被撤订单记录的报价状态更新类型（简称状态，下同），会员内部编号、订单编号不变，不生成新的订单记录。

本方发起对对手方报价申报的确认申报，本方会新增一笔订单记录，会员内部编号为确认申报时提供的会员内部编号。订单编号由固定收益平台生成。

本方发起对对手方报价申报的拒绝申报，本方不会新增订单记录。

对手方发起对本方报价申报的确认申报、拒绝申报，对应本方报价申报的订单记录的状态会发生变更，会员内部编号、订单编号不变。

三方回购质押券转入、三方回购质押券转出时会同时对转入/转出、转出/转入账户各生成一笔订单记录，订单编号不同，会员内部编号相同。

序号	字段名	数据类型	长度	格式
1	类型	TEXT	3	001：现券意向 002：现券确定报价 003：现券成交申报（点击成交、最优价成交、可转成交） 004：现券协议交易 005：现券指定对手方 100：转托管 101：可交换债换股 102：债券回售 103：创新创业债转股冻结 201：询价 202：被询价（被询价方报价） 301：协议回购意向 302：协议回购首次 303：协议回购到期确认 304：协议回购到期续做 305：协议回购解除质押 306：协议回购换券 307：协议回购提前终止

				401：三方回购意向 402：三方回购指定对手方 403：三方回购到期购回 404：三方回购到期续做 405：三方回购解除质押 406：三方回购换券 407：三方回购提前终止 408：三方回购补券 409：三方回购质押券转入 410：三方回购质押券转出
2	订单状态更新类型	TEXT	2	0：本方新增 5：对手方拒绝 6：本方撤销 7：超时 11：已成交 21：部分成交 22：询价方未与本方报价成交
3	订单号	NUMBER	10	交易所订单编号
4	会员内部编号	TEXT	10	本方会员内部编号
5	证券账户	TEXT	11	对三方回购质押券转入，买卖方向为 1（转入）时，为三方回购专用账户，买卖方向为 2（转出）时，为普通账户 对三方回购质押券转出，买卖方向为 1（转入）时，为普通账户，买卖方向为 2（转出）时，为三方回购专用账户
6	买卖方向	TEXT	1	1：买/正回购/转入 2：卖/逆回购/转出 对协议回购、三方回购为回购方向 对三方回购质押券转入、三方回购质押券转出为转入转出方向

5.5 未结算协议回购/三方回购

RepurReturnRequirementData	**未结算协议回购/三方回购**

描述：

未结算协议回购/三方回购文件每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的文件，刷新时采用**全量刷新**方式。

每个文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在刷新行情内容前清空，在刷新行情内容后回填，可作为刷新完成的标志。

该文件必须以只读方式打开读取，并且在内容读取完成后，及时关闭。若一直保持在打开状态，会影响系统的自动刷新。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录各字段（除债券明细字段外）的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

RepurReturnRequirementData	未结算协议回购/三方回购

每日未结算协议回购/三方回购文件记录数、顺序（按成交日期从前往后、成交日期相同时按成交编号从小到大）不会改变，仅操作状态值可能会产生改变，其余字段内容不会改变。

未结算协议回购/三方回购文件落地当前登录交易员所属交易商全量未结算信息（若当前登录交易员无协议回购/三方回购交易权限，则不落地相关的未结算信息）。

对到期状态为 3（当日到期）的未结算，可发起协议回购到期确认申报、协议回购到期续做申报、三方回购到期购回申报、三方回购到期续做申报。

对到期状态为 4（未到期）的未结算，可发起协议回购换券申报、协议回购提前终止申报、三方回购换券申报、三方回购提前终止申报、三方回购补券申报。

对到期状态为 5（已过期）的未结算，可发起协议回购解除质押申报、三方回购解除质押申报。

序号	字段名	数据类型	长度	小数	格式
1	类型	TEXT	3		300：协议回购 400：三方回购
2	成交日期	TEXT	8		格式 YYYYMMDD
3	成交编号	NUMBER	10		交易所成交编号
4	到期状态	TEXT	1		3 当日到期 4 未到期 5 已到期
5	操作状态	TEXT	1		0：未操作 1：已到期结算 2：请求到期续做 3：已到期续做 4：请求解除质押 5：已解除质押 6：请求换券 7：已换券 8：请求提前终止 9：已提前终止
6	回购方向	TEXT	1		交易商对该笔未结算记录的回购方向 0：同时为正回购方与逆回购方 1：正回购 2：逆回购
7	回购利率	NUMBER	10	3	单位：%，精确到%小数点后 3 位。例如：现实中 3.456%在此字段应填 3.456
8	回购到期日	TEXT	8		格式 YYYYMMDD
9	到期结算日	TEXT	8		格式 YYYYMMDD
10	回购期限	NUMBER	3		单位：天
11	实际占款天数	NUMBER	3		单位：天。此字段可能出现与回购期限天数不相同，可理解为预

					期占款天数。
12	首次成交金额	NUMBER	16	2	单位：元
13	到期结算金额	NUMBER	16	2	单位：元，到期结算金额=首次成交金额+参考应计利息
14	参考应计利息	NUMBER	12~~6~~	2	单位：元，由实际占款天数计算得到
15	质押券面值总额	NUMBER	16		单位：元 对协议回购，为质押券面值总额 对三方回购无效，为空
16	质押券担保价值	NUMBER	16	3	单位：元 对三方回购，为质押券合计担保价值 对协议回购无效，为空
17	正回购交易商代码	TEXT	3		
18	正回购交易商简称	TEXT	10		
19	正回购交易员代码	TEXT	6		
20	正回购证券账户	TEXT	10		文件所属交易商为正回购方时，显示正回购方证券账户 文件所属交易商为逆回购方时无效，为空
21	正回购交易单元	TEXT	5		文件所属交易商为正回购方时，显示正回购方交易单元 文件所属交易商为逆回购方时无效，为空
22	逆回购交易商代码	TEXT	3		
23	逆回购交易商简称	TEXT	10		
24	逆回购交易员代码	TEXT	6		
25	逆回购证券账户	TEXT	10		文件所属交易商为正回购方时无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时，显示逆回购方证券账户
26	逆回购交易单元	TEXT	5		文件所属交易商为正回购方时无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时，显示逆回购方交易单元
27	质权人名称	TEXT	30		
28	正回购证券账户名称	TEXT	30		对协议回购无效，为空
29	正回购方投资者名称	TEXT	30		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时无效，为空 文件所属交易商为正回购方时，显示正回购方投资者名称
30	正回购方产品委托人	TEXT	30		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时无效，为空 文件所属交易商为正回购方时，显示正回购方产品委托人
31	正回购方杠杆运作限制	TEXT	120		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时无效，为空 文件所属交易商为正回购方时，显示正回购方杠杆运作限制
32	逆回购方证券账户名称	TEXT	30		对协议回购无效，为空

33	逆回购方投资者名称	TEXT	30		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为正回购方时无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时，显示逆回购方投资者名称
34	逆回购方产品委托人	TEXT	30		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为正回购方时无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时，显示正回购方产品委托人
35	逆回购方杠杆运作限制	TEXT	120		对协议回购无效，为空 文件所属交易商为正回购方时无效，为空 文件所属交易商为逆回购方时，显示正回购方杠杆运作限制
36	违约后是否进行担保品快速处置	TEXT	1		对协议回购无效，为空 对三方回购，为违约后是否进行担保品快速处置标识：Y 是，N 否
37	交收编号	TEXT	16		对协议回购无效，为空
38	篮子信息	TEXT	10		B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他 对三方回购，为篮子信息。右对齐，由 8 位 1、0 数字组成，代表第 1 号至第 8 号篮子。例如指定 1，2，5 号篮子，填写“11001000” 对协议回购无效，为空
39	原补充约定	TEXT	170		补充条款 对协议回购无效，为空
40	债券明细	TEXT	变长		`*为分隔符，每组债券明细信息间各个字段以`分隔，以*结束 ● 协议回购时（仅会有一条债券信息）：质押券代码`质押券简称`质押数量（单位：手）`实际折算比例（单位：%，精确到%小数点后 2 位。例如：现实中 3.45%在此处应填 3.45）* ● 三方回购时（可能有多条债券信息）：质押券代码`质押数量（单位：手）`专户账户`担保品价值（单位：元）*

5.6 三方回购质押券所属篮子信息

TriPartyRepoBktData	三方回购质押券所属篮子信息

描述：

每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的三方回购质押券所属篮子信息文件，该文件**当日仅自动落地一次，可手动落地**。

文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在~~在~~落地过程中为空，在落地完毕后后回填，可作为落地完成的标志。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

序号	字段名	数据类型	长度	小数	格式
1	债券代码	TEXT	6		
2	债券简称	TEXT	30		
3	所属质押券篮子编码	TEXT	4		B001：利率债 B002：AAA（公） B003：AA+（公） B004：AA（公） B005：AAA（私） B006：AA+（私） B007：AA（私） B008：其他
4	质押券篮子折扣率	NUMBER	10	3	

5.7 债券是否非担保信息

IsUnsecuredData	债券是否非担保信息

描述：

每次启动 EzDA 并成功登陆后，生成一个单独的债券是否非担保信息文件，该文件**当日仅自动落地一次，可手动落地**。

文件的第一行包括两个字段：更新时间、记录数，字段间使用竖线分隔。在落地过程中为空，在落地完毕后后回填，可作为落地完成的标志。

从文件的第二行开始为实际记录内容。每条记录为定长数据，各字段的长度固定，如无特殊说明，内容采用右对齐，前补空的方式，字段之间采用竖线（|）分隔。

文件内不含产品类型为：质押式协议回购，三方回购，CDS 合约，CDS 凭证，特定债券

文件内不包含到期，摘牌，禁止状态的券。

IsUnsecuredData	债券是否非担保信息
是否非担保字段不排除为空值。	

序号	字段名	数据类型	长度	小数	格式
1	债券代码	TEXT	6		
2	是否非担保	TEXT	1		Y：非担保 N：担保

6 附录

6.1 错误代码表

错误码	描述	补充说明
7000	不能为空	该字段取值不能为空
7001	不能为 0	该字段取值不能为 0
7002	不能全为空格	该字段取值不能全为空格
7003	长度错误	该字段的长度不符合接口要求
7004	小数点后保留位数错误	该字段小数点后保留位数不符合接口要求
7005	数据大小出错	该字段的数值大小不符合接口要求
7006	数据类型格式出错	该字段的数据类型不符合接口要求
7007	配置文件不匹配	未使用
7008	需校验参数缺失	报文所需字段缺失
7009	报文读取错误	未使用
7010	超出值域范畴	该字段的取值不在接口规定的取值值域中
7011	发起方交易商代码不匹配	发起方交易员所属交易商与报文中所填交易商不匹配
7012	发起方交易员代码不匹配	发起方交易员的交易员代码与报文中所填交易员代码不匹配
7013	报价会员内部编号为空	未使用
7014	撤单会员内部编号为空	未使用
7015	成交会员内部编号为空	未使用
7016	报文类别为空	未使用
7017	保留字符出错	未使用
7018	金额错误	报文填写数值与系统计算结果不匹配
7019	不能小于等于当前交易日	未使用
7020	不能大于到期结算日	未使用
7021	不能小于当前交易日	
7022	不能大于或等于回购到期日	未使用
7023	不能大于或等于到期结算日	未使用

7024	天数计算错误	报文填写数值与系统计算结果不匹配
7025	申请类别不匹配	报文中 QuoteType（537）与 MsgType（35）以及业务类型编号（reqid）不匹配
7026	重复组数目不匹配	报文填写重复组数值与报文中重复组数目不匹配
7027	整数位数出错	该字段整数位数不符合接口文档要求
7028	小数位数出错	该字段小数位数不符合接口文档要求
7029	质押券代码不存在	无效的债券代码
7030	交易员与交易商不匹配	对手方交易员代码与对手方交易商代码不匹配
7031	不能小于等于首次结算日	
7032	需等于回购到期日	
7033	请求编号不存在	要约编号或报价请求编号不存在，或可能已被撤销、确认或拒绝
7034	质押券代码不匹配	质押券代码与待撤销、确认或拒绝订单不匹配
7035	投资者账户不匹配	质押券代码与待申报、确认或拒绝订单不匹配
7036	PBU 不匹配	未使用
7037	对手方交易员不匹配	对手方交易员与待确认或拒绝的订单不匹配
7038	消息类型不存在	请求业务类型编号（reqid）或 MsgType（~~537~~35）不存在，或两者组合定义的消息类型不被系统支持
7039	原成交编号不匹配	成交申报时交易所成交编号与待确认的交易所报价请求编号对应的订单不匹配
7040	买卖方向不匹配	买卖方向与待撤销、确认或拒绝订单不匹配
7041	未成功匹配交易订单	待撤销订单不存在、已撤销、已被确认或已被拒绝
7042	成交编号不存在	符合存续期报价请求的未结算协议回购中不存在该成交编号
7043	本期结算回购利息不匹配	符合存续期报价请求的未结算协议回购中，报文成交编号对应的本期结算回购利息与报文填写值不匹配
7044	到期续做类型不匹配	未使用
7045	到期结算金额不匹配	换券申报、到期确认申报时到期结算金额与原成交申报到期结算金额不一致
7046	成交金额不匹配	换券申报的成交金额与原成交申报时成交金额不一致
7047	必须等于当前交易日	
7048	质押券已到期或已摘牌	
7049	质押券数量不匹配	到期续做质押券数量与原质押券数量不一致
7050	取值必须为 0	
7051	取值必须在 0 至 10 亿之间	不包含 0 或 10 亿

7052	取值必须大于 0	
7053	成交日期不匹配	符合存续期报价请求的未结算协议回购中，报文成交编号对应的成交日期与报文填写值不匹配
7054	篮子数据错误	篮子不存在或篮子超出值域
7055	篮子信息重复	篮子编号不可重复
7056	券所属篮子不在篮子列表内	质押券与篮子不匹配
7057	操作标识重复	操作标识不唯一
7058	不在原篮子列表内	三方回购补券申报填写的篮子编号不在原始篮子列表中
7059	质押券不能重复	三方回购指定对手方申报提供的质押券代码不能重复
7060	质权人名称不匹配	
7061	不能等于原成交金额	协议回购提前终止申报时实际结算金额不能与原成交金额一致
1000	交易商不存在	对手方交易商不存在
1001	交易商被禁用	本方交易商被禁用
1002	用户不存在	交易员用户不存在
1003	用户被禁用	本方交易员被禁用
1007	产品不存在	
1008	产品被禁用	产品状态非正常
1011	席位不存在	
1012	席位被禁用	
1013	该席位不属于改交易商	
1014	账户不存在	
1015	账户被禁用	
1016	账户与席位无指定关系	
1019	证券不存在	
1020	证券被禁用	停牌
1022	价格超过价格波动幅度	
1033	未满足做市报价最小报价数量	
1034	买卖收益率价差超过做市报价收益率价差	
1039	询价对手方超过最大数量	
1040	错误的报价步长	

1041	做市券种只能有一条有效报价	一个做市商对一只做市券种同一时间只能有一条有效报价
1043	该报价已撤销	
1044	该报价已成交	
1045	该报价已强制撤单	
1046	可用余额不足	
1058	会员不存在	
1066	未开市	
1068	未开盘	
1071	已休盘	
1093	非本方数据	
1095	系统状态不正确	
1096	报价类型不对	
1097	买卖标志不对	
1098	报价数量必须是点击成交单位的整数倍	
1099	必须是同一操作员	待操作订单不属于该交易员
1100	必须为不同的交易商	
1101	无效的做市商标志	
1102	不是做市商	
1103	非做市品种	
1104	无效的做市账户	
1105	做市券种不存在	
1106	必须双边报价	
1107	无效的指令	
1108	双向报价编号不存在	
1109	无效的报价状态	
1110	报价不存在	
1111	无效的报价状态	
1112	报价类型不对	
1114	要约号不存在	
1115	无效的要约状态	

1123	账户席位不存在	报文中申报的账户席位没有维护在申报报文的交易商下（交易端（首席交易员）-->系统维护-->交易员账户管理）
1142	已经收盘	
1143	已经闭市	
1145	请选择交易商	
1147	报价数量应该大于或等于询价最小成交数量	交易端：查询统计-->产品查询的“最小询价数量”
1149	要约已经撤销	
1151	要约已经否决	
1152	要约已经成交	
1153	要约已经中止	
1154	要约已经强制撤单	
1163	对手方被禁用	
1166	被询价商数据不对	
1172	交易员的账户席位不存在	
1173	该产品已经收盘	
1174	该证券已经收盘	
1175	该产品还没有开盘	
1176	该证券还没有开盘	
1177	交易商的做市券种被禁用	
1188	质押券持仓不足	
1189	质押券无持仓	
1190	证券不是国债现券	
1207	数据不匹配	
1212	债券被摘牌	
1213	冰山数量不对	
1214	未开盘,必须是做市报价	
1217	场务端点击成交数量配置错误	
1219	对方报价数量不足	
1222	成交数量必须大于或者等于成交申报最小数量	
1227	已做隔夜回购业务,不允许现券交易	

1234	数据不匹配	
1246	持仓不存在	
1247	部分冻结	
1249	交易指令暂不可用	
1252	没有最优报价	
1253	未找到符合要求的报价	
1254	对手方交易商错	最优价成交申报时，市场最优价所属交易商非申报时填写的对手方交易商
1270	帐号限制表已满	
1271	账户买卖权限接口中的交易类型定义错	
1273	数量不等于报价成交单位	确定报价点击成交、最优化成交和可转换成交申报时，订单数量必须等于报价成交单位（报价成交单位可通过交易端查询--：查询统计→产品查询）
1274	输入价格与指定的报价订单价格不一致	
1275	债券已到期	
1276	指定订单的券错误	
1277	打开托管银行文件失败	
1278	打开标准券文件失败	
1289	没有对应的交易品种	
1297	交易系统正忙,请稍后处理	~~?~~
1298	私募债持有账户数超过最大户数	
1299	私募债不支持此交易方式	
1300	该品种不是私募债或信贷资产支持证券	
1301	账户必须为 A/B/D/F 开头的账户	
1302	约定号重复	
1303	未到期数据不存在	检查成交日期和原成交编号是否在未到期数据文件中
1304	无效的未到期状态	检查未到期数据的状态与报价类别是否匹配（比如到期续作申报、到期确认申报的未到期数据状态必须为当日到期）
1305	未找到相应的回购期限	回购期限不能小于等于 0
1306	无效的回购期限	回购期限不能大于 365
1307	无效的未到期标志	
1314	已到期结算申报	

1315	已到期续做申报	
1316	已到期续做确认	
1317	已解除质押申报	
1318	已解除质押确认	
1319	已换券申报	
1320	已换券申报确认	
1321	已提前终止申报	
1322	已提前终止确认	
1325	备注信息表已满	
1326	回购期限对应的品种不存在	~~?~~
1329	非中央结算交易时段	
1330	非中国结算交易时段	
1331	中央结算交易已暂停	
1332	中国结算交易已暂停	
1334	中央结算的证券不支持此交易方式	
1336	无效的换股代码	
1337	无效的回售代码	
1338	债券代码不匹配	
1339	结算场所不匹配	
1356	无效的转股代码	
1357	协议回购不支持此交易方式	
1358	三方回购不支持此交易方式	
1361	无效的换股价格	
1362	无效的回售价格	
1363	无效的转股价格	
1371	结算方式不匹配	
1372	非担保券结算方式错误	
1373	担保券结算方式错误	
1376	仅支持凭证式券	
1501	交易商没有产品执行权限	

1502	交易员没有产品执行权限	
1503	交易员没有卖出权限	
1504	交易员没有买入权限	
1505	账户没有买入权限	
1506	账户没有卖出权限	
1507	该证券没有此种交易类型的权限	
1508	该债券没有担保交易权限	
1509	无效的价格	
1516	账户对该交易产品没有交易权限	
1517	特定债券不支持该业务	
1520	询价对象最多只能选择一个普通交易商	
1603	余额打通拼包出错	
1604	余额打通冲销出错	
1800	信息包重复,请手工查询处理结果	
1801	无效的卖出方 PBU 代码	NGTS 报错：10270
1802	卖出方投资者帐户与卖出方 PBU 无指定交易关系	NGTS 报错：10702
1803	卖出方投资者帐户已被暂停	NGTS 报错：10706
1804	无效卖出方投资者帐户	NGTS 报错：10712
1805	无效申报数量	NGTS 报错：10828
1806	投资者持仓不足	NGTS 报错：10836
1807	卖出方 PBU 已被暂停	NGTS 报错：10956
1808	无效卖出方投资者帐户	NGTS 报错：11026
1809	无效的交易员代码	NGTS 报错：11036
1810	投资者冻结量不足	NGTS 报错：11044
1811	投资者持仓不足	NGTS 报错：11050
1812	PBU 对该产品没有买权限	NGTS 报错：11060
1813	PBU 对该产品没有卖权限	NGTS 报错：11064
1814	投资者对该产品没有买权限	NGTS 报错：11080
1815	投资者对该产品没有卖权限	NGTS 报错：11082
1816	PBU 对该产品子类型没有买权限	NGTS 报错：11262

1817	PBU 对该产品子类型没有卖权限	NGTS 报错：11264
1818	投资者对该产品子类型没有买权限	NGTS 报错：11266
1819	投资者对该产品子类型没有卖权限	NGTS 报错：11268
1820	指令操作来源无效	NGTS 报错：13460
1821	指令持仓操作类型无效	NGTS 报错：13462
1822	冻结/解冻操作类型	NGTS 报错：13464
1823	买方 PBU 已经被暂停	NGTS 报错：13468
1824	无效过户方 PBU 的 PBU 代码	NGTS 报错：13470
1825	买方投资者帐户与过户方 PBU 无指定交易关系	NGTS 报错：13472
1826	买方投资者帐户已被暂停	NGTS 报错：13474
1827	无效买方投资者帐户	NGTS 报错：13476
1828	无效买方投资者帐户	NGTS 报错：13478
1829	无效的产品	NGTS 报错：30005
1830	PBU 未配置该产品的交易权限	NGTS 报错：11068
1831	指令请求类型无效	NGTS 报错：13466
1832	打包消息中消息头的信息错误	NGTS 报错：18200
1833	打包消息中的指令长度错误	NGTS 报错：18202
1834	持仓更新指令掩码中的双边信息与输入参数不一致	NGTS 报错：18204
1835	持仓更新指令的掩码不存在，非法掩码	NGTS 报错：18206
1836	持仓更新指令的掩码尚未启用	NGTS 报错：18208
1837	持仓更新指令的掩码不可用于 ETF 申赎	NGTS 报错：18210
1838	无目标地址	NGTS 报错：10756
1839	错误产品类型	NGTS 报错：10246
1840	产品无法使用	NGTS 报错：10398
1841	无效的 PBU ID	NGTS 报错：10534
1842	无效的非交易 isix 或者 setId	NGTS 报错：13308
1849	后台系统错误	
1850	后台未知错误	
1917	协议回购暂不支持此交易方式	
1920	对手方交易员不存在	

1921	此交易方式不支持协议回购的券	
1922	质押券不支持此类交易	
1925	该报价已被拒绝	
1952	数量错误	现券指定对手方匹配成交时，申报的数量与对手方已成功发起的申报填写的数量不一致
1953	价格错误	现券指定对手方匹配成交时，申报的价格与对手方已成功发起的申报填写的价格不一致
1958	非担保券不允许匿名报价	
3000	服务器正忙	登录时异常，或监听数据时异常
3001	非法登录用户	用户登录请求异常，用户信息获取失败
3002	初始化数据出错	系统初始化数据处理异常
3009	通讯主机 Socket 未开，连接被拒绝	后台主机服务未启动
3013	交易系统主机连接不上	与后台主机重连后失败
3020	用户请求非法	发送请求报文中 request_id 为空
3021	用户已禁止	会话请求中 SessionId 失效
3028	上传数据校验失败	请求数据 MD5 码校验失败
3032	重复的消息号	中台防重校验
3101	当前版本不支持	登录使用的 EzDA 版本非固收当前支持的版本
9999	用户已注销，请重新登录	后台已注销该用户