

深圳证券交易所
SHENZHEN
STOCK EXCHANGE



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

债券质押式协议回购业务之

券商技术系统变更指南

(Ver1.23)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇二〇年十二月

关于本文档

文档名称		债券质押式协议回购业务之券商技术系统变更指南	
说明			
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2015-05-26	1.00	创建文档	技术开发版
2015-06-26	1.10	修订文档	1. 购回交易指令中的数量由0改为填写初始交易的质押数量 2. 明确投资者适当性管理要求
2016-07-31	1.20	修订文档	升级到新一代交易系统接口
2018-05-23	1.21	修订文档	1. 购回交易的期限（ExpirationDays）字段固定填为0 2. 新增到期续做交易

2020-07-15	1.22	修订文档	债券质押式协议回购优化: 1. 新增债券交易账户体系。债券交易账户体系包含交易商、交易主体及交易员等要素,以便于将协议回购业务的参与方落实到具体的产品、机构、个人,符合市场对协议回购交易进行风控、统计的需求以及对于债券类交易的一贯方式和习惯; 2. 引入成交请求模式、成交报告模式,废除协议配对模式。支持多种委托申报方式,包括:初始交易、到期购回、到期续做、提前购回、质押券变更、解除质押且到期续做时支持变更续做逆回购方。 3. 新增固定收益交易平台,并将优化后的协议回购业务迁移至固定收益交易平台,市场参与者人需要修改交易网关配置增加平台6(固定收益交易平台 的平台代码为6)的配置信息,才能在新平台继续开展协议回购业务
2020-12-04	1.23	修订文档	(本文档中橙色修订部分) 1、委托回报中新增字段:股份性质(ShareProperty); 2、补充说明:正回购方发起变更对手方的到期续做时,转发给新逆回购方的转发成交申报中会附带本合约的已质押券信息。

目录

一、	说明.....	1
二、	业务简介.....	1
2.1	交易流程.....	1
2.2	其他说明.....	3
三、	技术实现概况.....	3
3.1	成交请求模式.....	3
3.2	成交报告模式.....	3
3.3	支持债券交易账户体系.....	4
3.4	交易编号扩位.....	8
3.5	存量合约的过渡处理.....	9
3.6	平台迁移网关配置.....	10
四、	成交申报.....	10
4.1	Binary 接口委托申报.....	10
4.2	STEP 接口委托申报.....	43
五、	转发成交申报.....	78
5.1	Binary 接口转发成交申报.....	78
5.2	STEP 接口转发成交申报.....	86
六、	成交申报响应.....	95
6.1	Binary 接口成交申报响应.....	95
6.2	STEP 接口成交申报响应.....	98
七、	成交确认.....	101
7.1	Binary 接口成交确认.....	101
7.2	STEP 接口成交确认.....	104
八、	清算和交收.....	107
九、	开展债券质押式协议回购业务的券商系统注意事项.....	107
9.1	行情相关说明.....	107
9.2	委托回报相关说明.....	107
9.3	关于客户委托服务渠道.....	107
9.4	关于券商柜台系统.....	107
十、	联系方式.....	108
附件一、	债券质押式协议回购业务的结算数据接口修订说明.....	109
一、	结算数据接口修订.....	109
1.1	接口修订简要说明.....	109

1.2	清算明细库 SJSMX0.DBF.....	110
1.3	交收明细结果库 SJSJG.DBF.....	114
1.4	综合数据服务库 SJSFW.DBF.....	120
1.5	资金清算汇总库 SJSQS.DBF.....	121
1.6	广播类信息库 SJSGB.DBF.....	122
二、	联系方式.....	123

债券质押式协议回购业务之券商技术系统 变更指南

一、 说明

为了会员和其他交易参与人在深圳证券交易所（以下简称“本所”）交易系统上更好地开展债券质押式协议回购（以下简称“协议回购”）业务，本所会同中国结算深圳分公司专门编制和发布本指南，供相关交易参与者及其 IT 提供商参考。

本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量减少系统改造对会员和其他交易参与者带来的影响。

特别提示：如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、 业务简介

协议回购是指回购双方自主协商约定，由正回购方（即资金融入方）将债券出质给逆回购方（即资金融出方）以融入资金，并在未来返还资金和支付回购利息，同时解除债券质押登记的交易。

2.1 交易流程

- （1）正回购方按照规定格式提交初始交易委托，委托中包含成交金额、回购期限、回购利率、质押券证券代码、**股份性质**和数量以及指定的逆回购方交易商、交易主体和交易员等信息；
- （2）交易系统对初始交易委托进行即时确认，并将初始交易委托转发给逆回购方；
- （3）逆回购方对交易系统转发的初始交易委托中的成交金额、回购期限、回购利率、质押券证券代码、**股份性质**和数量等要素进行确认，若拒绝达成成交，则申报拒绝的响应委托；若同意达成成交，则申报接受的响应委托；
- （4）交易系统对于逆回购方申报的拒绝成交申报委托进行即时确认，并生成转发成交申报发给正回购方，以通知正回购方申报的初始交易委托被逆回购方拒绝。

- (5) 交易系统对于逆回购方申报的接受成交申报委托与正回购方申报的初始交易委托进行配对撮合,向交易双方与中国结算深圳分公司即时发送成交回报。中国结算深圳分公司将对成交中指定的质押券进行质押冻结;
- (6) 回购到期日之前(不含回购到期日,以下简称“待购回期间”),正回购方可以按照约定格式提交质押券变更委托,经逆回购方确认后,可实现质押券换入、换出以及债券质押期间债券付息、分期偿还等所产生的现金的换出;
- (7) 待购回期间,正回购方可以按照规定格式提交提前购回委托,委托中包含提前购回的回购利率信息,经逆回购方确认后,可以提前了结合约;
- (8) 回购到期日,正回购方可按照规定格式提交到期购回委托了结合约,到期购回委托无需逆回购方确认;
- (9) 回购到期日,正回购方可按照规定格式提交到期续做委托,经逆回购方确认后,可实现合约续做;允许到期续做时变更逆回购方,也可以不变更逆回购方;
- (10) 若未能在回购到期日及时了结或续做合约,在回购到期日之后,正回购方可按照规定格式提交解除质押委托了结合约,解除质押委托需逆回购方确认;
- (11) 深交所交易系统对质押券变更委托、到期购回委托、到期续做委托、提前购回委托、解除质押委托进行即时成交确认,向交易参与人与中国结算深圳分公司即时发送成交回报;
- (12) 中国结算深圳分公司依据深交所确认的成交结果为协议回购提供相应的证券质押冻结和清算交收等服务。

上述交易流程中涉及的委托是否允许撤单如下表所示:

委托类型	是否允许撤销	备注
初始交易	是	在对手方提交匹配的申报后不得撤销
提前购回	是	在对手方提交匹配的申报后不得撤销

到期购回	否	
到期续做	是	在对手方提交匹配的申报后不得撤销
解除质押	是	在对手方提交匹配的申报后不得撤销
质押券变更	是	在对手方提交匹配的申报后不得撤销

2.2 其他说明

(1) 交易时间为每个交易日的 9: 15 至 11: 30, 13: 00 至 15: 30。

(2) 会员和其他交易参与人应当根据业务规则和自身风险承受能力控制业务规模, 并实施股份、资金前端监控。

三、 技术实现概况

3.1 成交请求模式

成交请求模式消息处理流程请参考《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“3.8.3 成交请求申报模式 (one party report for pass through)”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“3.8.3 成交请求申报模式 (one party report for pass through)”一节。

协议回购交易业务的初始交易、到期续做、提前购回、解除质押、质押券变更申报使用成交请求申报模式。

3.2 成交报告模式

成交报告模式处理流程参见《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)”一节或《深圳证券交易所

STEP 交易数据接口规范》“3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)”一节。

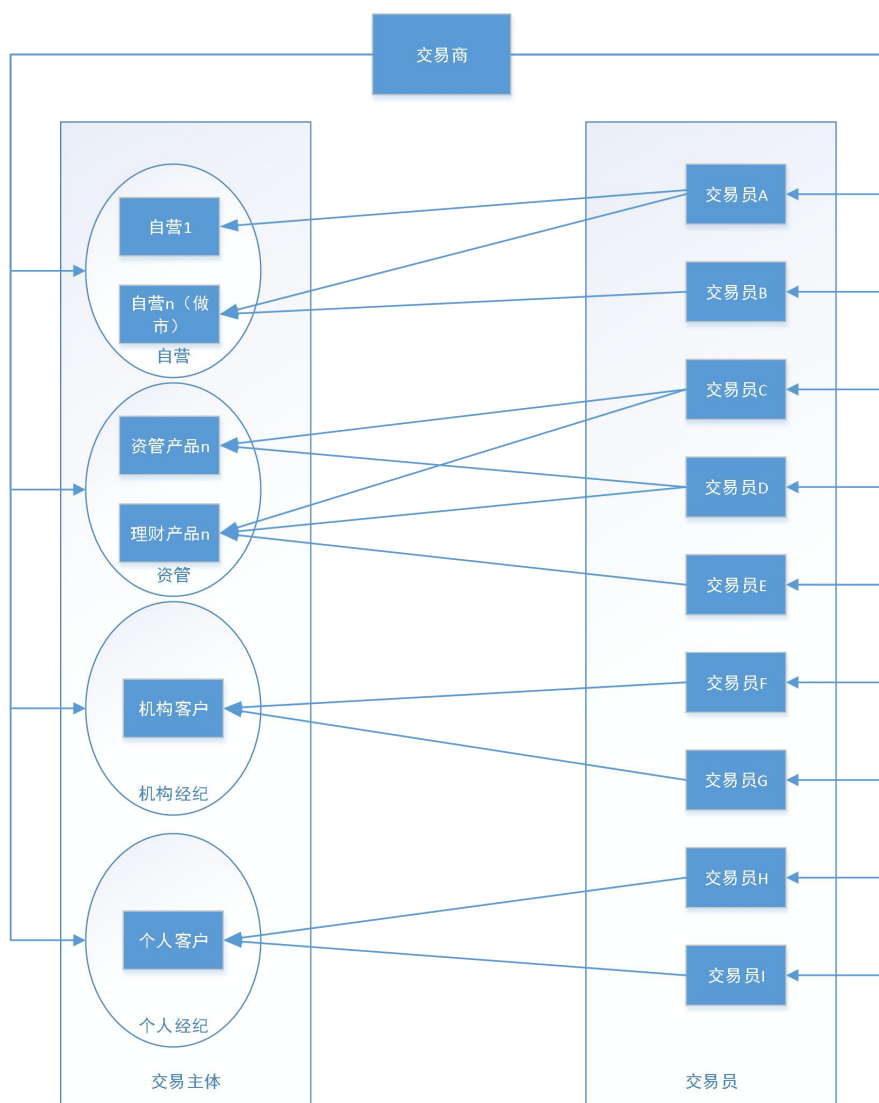
协议回购交易业务的到期购回使用成交报告模式。

3.3 支持债券交易账户体系

本指南 1.22 版本支持债券交易账户体系。

3.3.1 债券交易账户体系业务模型

业务模型如下图所示：



如上图所示，整个债券交易过程中会涉及三类主体：交易商、交易主体和交易员。在交易过程中需要向对手方揭示的本方信息也是包含上述三类主体。

交易商指可直接参与债券交易的交易参与人，包括证券公司、银行、基金和保险公司等类型。

交易主体为交易商下实际参与债券交易的主体。交易主体按类型分为自营、资管、机构经纪和个人经纪四类，同一类型可以有多个交易主体。对于自营和资管类型，每个交易主体对应 1 个一码通账户；对于机构经纪和个人经纪类型，该交易主体为该交易商下所有机构或个人客户的统称，交易主体与实际的经纪客户没有直接映射关系。初期业务上会限制每个交易商仅可报备 1 个机构经纪和 1 个个人经纪类型的交易主体。综上，如交易商为中信证券，它的交易主体可能包括中信证券自营、中信证券资管 A 产品、中信证券资管 B 产品、中信证券机构经纪以及中信证券个人经纪等。

债券交易都是通过交易员达成。每个交易商可拥有多名交易员，每个交易员仅可归属于一个交易商。交易商负责对交易员的交易权限进行管理，交易员可拥有所属交易商下多个交易主体的交易权限。

3.3.2 交易商信息报备

交易商在参与债券交易之前必须先进行信息报备，包括交易主体、交易员和转发委托接收交易单元等信息。

（一）交易主体报备

交易商需在固收专区为其名下的交易主体进行报备。

➤ 当交易主体类型为自营或资管时，需提供如下信息：

序号	内容	备注
1	一码通账户号码	该一码通账户号码必须存在
2	交易主体类型	取值范围：自营、资管
3	交易主体名称	按业务要求进行命名

4	证券账户号码 清单	必须属于该一码通账户下对应证券账户号码清单范围内
---	--------------	--------------------------

- 当交易主体类型为机构经纪或个人经纪时，则仅提供交易主体名称即可。

交易主体报备成功后，固收专区为该交易主体生成全市场唯一的“交易主体代码”，并维护“交易主体代码”与交易商之间的对应关系。

交易商可以对交易主体的名称、类型和证券账户号码清单进行变更操作。

交易商可以注销交易主体，已注销的交易主体代码不复用。

（二）交易员报备

交易商需在固收专区为其名下交易员进行报备，需提供如下信息：

序号	内容	备注
1	交易员名称	必填，同一交易商下不可重复
2	联系方式	必填

报备成功后，固收专区为该交易员分配全市场唯一的“交易员代码”，并维护交易员代码与交易商之间的对应关系。

交易商可以通过固收专区对交易员信息进行修改，例如可以输入已有交易员代码，修改对应的交易员名称和联系方式。

交易商可以注销交易员。已注销的交易员代码不复用。

（三）设置转发委托接收交易单元

交易商需通过固收专区设置 1 或多个（不超过 10 个）交易单元作为转发委托接收交易单元。该交易单元用来接收债券交易过程中定向转发给该交易商的委托，例如向该交易商进行的询价委托、发给该交易商的待确认的成交请求等。

交易商可以对转发委托接收交易单元进行变更操作。

交易系统在下一交易日开市前将交易商信息、交易主体信息和交易员信息作

为交易参考信息发送给市场参与者。

3.3.3 交易场景介绍

在债券交易账户体系下，成交请求模式、成交报告模式的基本流程不变，但在细节处理上存在以下差异：

1、交易双方不需要再填写对手方交易单元，只填写对手方的交易商代码、交易主体类型、交易主体代码、交易员代码即可。

2、由于交易双方不再填写对手方交易单元，因此交易系统在处理转发成交申报时，会根据实际业务场景，决定是将转发成交申报广播至对手方交易商下所有已报备的接收转发消息的交易单元，还是定向转发至该场景下合理的某一交易单元，具体如下：

序号	场景描述	转发情况描述
1	初始交易时，将正回购方发起的成交请求或成交请求主动撤单委托转发至逆回购方	根据申报中对手方交易商已设置的转发委托接收交易单元列表，给每个已报备的转发交易单元发送一笔转发成交申报，转发成交申报的请求编号（即转发成交申报中的客户成交申报编号（TradeReportID）字段）字段完全相同，券商端系统需根据请求编号字段对转发消息进行过滤、去重展示
2	到期续做（变更续做对手方）时，将正回购方发起的成交请求或成交请求主动撤单委托转发至新的逆回购方	同上
3	逆回购方点击拒绝时，将逆回购方的拒绝委托转发至正回购方	将转发成交申报定向发送给正回购方请求委托中的申报交易单元
4	到期购回时，将正回购方发起的成交请求委托转发至逆回购方	将转发成交申报定向发送给在途合约的逆回购方交易单元

5	提前购回、质押券变更、到期续做（不变更续做对手方）、解除质押时，将正回购方发起的成交请求或成交请求主动撤单委托转发至逆回购方	将转发成交申报定向发送给在途合约的逆回购方交易单元
6	到期续做（变更续做对手方）成交达成后，给原合约的逆回购方发送一笔原合约到期购回的转发成交申报	将转发成交申报定向发送给原合约的逆回购方交易单元

3、券商系统对于所有转发成交申报都必须保证能够展示给指定的接收方，不可以展示给无关人员。特别的，对于转发成交申报的接收方是经纪客户时，券商系统需保证转发成交申报不会被广播至无关的经纪客户。

3.4 交易编号扩位

本指南 1.22 版本启用 16 位交易编号。

本指南 1.22 版本生效之前达成的合约（以下简称为存量合约），交易编号只启用了前 8 位，后 8 位为空格；在本指南 1.22 版本生效后，对于这部分存量合约的到期购回、提前购回、解除质押、到期续做、质押券变更申报，交易编号字段应填写 8 位初始成交日期+8 位原交易编号非空部分组成的新交易编号，而非 1.22 版本之前的 8 位非空编号+8 位空格。到期续做不改变组合后的新交易编号。

例如，在本指南 1.22 版本生效前，于 2020 年 2 月 1 日达成一笔初始交易成交，成交确认消息的 TrdMatchID（交易编号）字段值为“12345678 ”。在本指南 1.22 版本生效后，申报到期续做委托时，委托中的 TrdMatchID（交易编号）字段应填写为“2020020112345678”；当续做再次到期申报到期购回委托时，委托中的 TrdMatchID（交易编号）字段也应填写为“2020020112345678”。

在本指南 1.22 版本生效后达成合约的交易编号为 16 位字符串，由交易所生成且跨交易日唯一，并由交易系统保证不与存量合约使用的 8 位初始成交日期+8 位原交易编号非空部分组成的新交易编号重复。交易系统对于每个初始交易达成的合约都会生成一个跨交易日唯一的交易编号，填入到成交确认消息的 TrdMatchID（交易编号）字段并发送给正、逆回购方，到期购回、提前购回、解除质押、到

期续做、质押券变更申报时应填写对应在途合约的交易编号。到期续做不改变在途合约的交易编号。

3.5 存量合约的过渡处理

由于本指南 1.22 版本业务优化后需支持债券参与人体系及交易编号的扩位，为保证券商端系统平滑切换，在本指南 1.22 版本生效后正常进行协议回购业务的展开，在 1.22 版本优化上线时，由交易系统提供存量合约补充信息文件供券商端系统完成存量合约的优化过渡。存量合约补充信息文件通过文件网关下发，且只会在上线当晚发送一次，其格式定义如下：文件名称：negotiable_repo_contract_sup_memberID.csv，其中 memberID 为交易商代码。

文件内容：包含存量合约正回购方交易商代码为 memberID 的所有存量合约记录。若交易商在上线时没有作为任何一条存量合约的正回购方交易商，则不会收到这个文件。若合约记录的正回购方交易商、逆回购方交易商任何一方未完成报备，则不会导出本条记录。

字段定义：

域名	类型	字段描述
TrdMatchIDOld	C16	旧交易编号，本指南 1.22 版本生效之前，初始交易成交确认消息中的 TrdMatchID（交易编号）字段，为 8 位非空编号+8 位空格
TrdMatchID	C16	新交易编号，本指南 1.22 版本生效后存量合约在进行质押券变更、提前购回、到期购回、到期续做、解除质押时需使用的 16 位非空编号，为本合约达成时的 8 位初始成交日期+原 8 位非空编号
MemberID	C6	正回购方交易商代码
InvestorID	C10	正回购方交易主体代码
CounterpartyMemberID	C6	逆回购方交易商代码
CounterpartyInvestorID	C10	逆回购方交易主体代码

注：

1. 记录的每个字段之间以逗号分隔，每条记录以行分隔符 0x0A 结束，首字段前和尾字段后不附加字段分隔符 TAB，最后一条记录后也附加行分隔符。

2. 对于 char[x]字符串型字段内容包含字符串实际值去掉右边的空格部分。

3.6 平台迁移网关配置

本指南 1.22 版本生效后，协议回购业务从综合金融服务平台迁移至固定收益交易平台，交易参与人需为开展协议回购业务的交易网关增加平台 6（固定收益交易平台）的配置信息，方能参与协议回购业务。

需修改的 config.xml 文件位于交易网关工作目录的 cfg 子目录下，配置信息参考如下：

```
<platform>
  <!-- 注释，可随意填写 -->
  <description>固定收益交易平台</description>
  <!-- 平台 ID，必须与深交所公布一致 -->
  <id>6</id>
  <!-- 监听地址，可根据需要自行修改 -->
  <interface>0.0.0.0</interface>
  <!-- 监听端口，可根据需要自行修改 -->
  <port>8024</port>
</platform>
```

四、 成交申报

4.1 Binary 接口委托申报

表 4- 1 初始交易委托消息定义

域名	字段描述	正回购方成交请求 字段取值	正回购方主动撤 单委托字段取值	逆回购方点击成 交申报（同意成交） 字段取值	逆回购方点击 成交申报（拒绝成 交）字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003				
ApplID	应用标识	300=债券质押式协 议回购	300=债券质押式协 议回购	300=债券质押式协 议回购	300=债券质押式协 议回购
SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方 交易单元一致	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳 分公司	01=中国结算深圳 分公司	01=中国结算深圳 分公司	01=中国结算深圳 分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报	0	0	2	3

	2=接受成交申报 3=拒绝成交申报				
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍
LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1031=初始交易	1031=初始交易	1031=初始交易	1031=初始交易
TrdSubType	成交申报业务子类别	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0

	预留，固定填 0				
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代 码	正回购方营业部代 码	逆回购方营业部代 码	逆回购方营业部代 码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代 码	正回购方交易商代 码	逆回购方交易商代 码	逆回购方交易商代 码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	正回购方交易主体 类型	正回购方交易主体 类型	逆回购方交易主体 类型	逆回购方交易主体 类型
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体 代码	正回购方交易主体 代码	逆回购方交易主体 代码	逆回购方交易主体 代码
InvestorName	本方客户名称 当本方交易主体类型为 03=机构经纪时，需填写	正回购方客户名称	正回购方客户名称	逆回购方客户名称	全空格

	本方客户名称				
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
TrdMatchID	交易编号, 跨交易日唯一	全空格	全空格	全空格	全空格
ExpirationDays	期限	购回期限	0	购回期限	购回期限
CashOrderQty	现金金额	初始成交金额	0.0000	初始成交金额	初始成交金额

Memo	备注	备注	备注	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	质押券个数	0	质押券个数	质押券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码	证券代码	无此字段	证券代码	证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	固定填 102	无此字段	固定填 102	固定填 102
→ DeliveryQty	数量	数量，单位为百元 发行面额	无此字段	数量	数量
→ DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	1	无此字段	1	1
→ ShareProperty	股份性质 00=无限售流通股 01=首发后限售股	00、01	无此字段	00、01	00、01

表 4- 2 Binary 接口到期续做委托消息定义

域名	字段描述	正回购方成交 请求字段取值	正回购方主动 撤单委托字段取值	逆回购方点击 成交申报（同意成 交）字段取值	逆回购方点击 成交申报（拒绝成 交）字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003				

ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购
SubmittingPBUID	申报交易单元, 需与本方交易单元一致	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel	0	1	2	2

	2=Replace				
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍	年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍
LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1033=到期续做	1033=到期续做	1033=到期续做	1033=到期续做
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方	10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方	10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方	10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方

ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代 码	正回购方营业部代 码	逆回购方营业部代 码	逆回购方营业部代 码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代 码	正回购方交易商代 码	逆回购方交易商代 码	逆回购方交易商代 码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	正回购方交易主体 类型	正回购方交易主体 类型	逆回购方交易主体 类型	逆回购方交易主体 类型
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体 代码	正回购方交易主体 代码	逆回购方交易主体 代码	逆回购方交易主体 代码
InvestorName	本方客户名称	正回购方客户名称	正回购方客户名称	逆回购方客户名称	全空格

	当本方交易主体类型为 03=机构经纪且成交申报业务子类别=11 变更续做对手方时，需填写本方客户名称				
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码

TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	全空格	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
ExpirationDays	期限	购回期限	填 0	购回期限	购回期限
CashOrderQty	现金金额	续做金额	填 0.0000	续做金额	续做金额
Memo	备注	备注	备注	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	填 0	填 0	填 0	填 0

表 4- 3 Binary 接口提前购回委托消息定义

域名	字段描述	正回购方成交 请求字段取值	正回购 方主动撤 单委托字 段取值	逆回购方点击 成交申报（同意成 交）字段取值	逆回购方点击 成交申报（拒绝成 交）字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003				
ApplID	应用标识	300=债券质押式协 议回购	300= 债 券 质 押 式 协 议回购	300=债券质押式协 议回购	300=债券质押式协 议回购

SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方交易单元一致	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
TradeReportTransType	成交申报事务类别	0	1	2	2

	0=New 1=Cancel 2=Replace				
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	提前购回的年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	提前购回的年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍	提前购回的年化利率, 单位为百分比, 取值范围: (0.0000,99.9900] 且必须为 0.01 的整数倍
LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1034=提前购回	1034=提前购回	1034=提前购回	1034=提前购回
TrdSubType	成交申报业务子类别	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0

	预留，固定填 0				
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码	逆回购方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码

InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	正回购方交易主体 类型	正 回 购 方 交 易 主 体 类型	逆回购方交易主体 类型	逆回购方交易主体 类型
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体 代码	正 回 购 方 交 易 主 体 代码	逆回购方交易主体 代码	逆回购方交易主体 代码
InvestorName	本方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代 码	正 回 购 方 交 易 员 代 码	逆回购方交易员代 码	逆回购方交易员代 码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	逆回购方交易商代 码	逆 回 购 方 交 易 商 代 码	正回购方交易商代 码	正回购方交易商代 码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管	逆回购方交易主体 类型	逆 回 购 方 交 易 主 体 类型	正回购方交易主体 类型	正回购方交易主体 类型

	03=机构经纪		类型		
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	逆回购方交易主体 代码	逆 回 购 方 交 易 主 体 代 码	正回购方交易主体 代码	正回购方交易主体 代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	逆回购方交易员代 码	逆 回 购 方 交 易 员 代 码	正回购方交易员代 码	正回购方交易员代 码
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交 易编号	全空格	对应初始交易的交 易编号	对应初始交易的交 易编号
ExpirationDays	期限	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
CashOrderQty	现金金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
Memo	备注	备注	备注	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	填 0	填 0	填 0	填 0

表 4- 4 Binary 接口质押券变更委托消息定义

域名	字段描述	正回购方成交请求字段取值	正回购方主动撤单委托字段取值	逆回购方点击成交申报（同意成交）字段取值	逆回购方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003				
ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购
SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方交易单元相同	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息

TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1036=质押券变更	1036=质押券变更	1036=质押券变更	1036=质押券变更

TrdSubType	成交申报业务子类别 预留，固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元	正回购方交易 单元	逆回购方交易 单元	逆回购方交易 单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户	正回购方证券 账户	逆回购方证券 账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代 码	正回购方营业 部代码	逆回购申报方 营业部代码	逆回购方营业 部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代 码	正回购方交易 商代码	逆回购方交易 商代码	逆回购方交易 商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管	正回购方交易主体 类型	正回购方交易 主体类型	逆回购方交易 主体类型	逆回购方交易 主体类型

	03=机构经纪				
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	逆回购方交易员代	逆回购方交易	正回购方交易	正回购方交易

		码	员代码	员代码	员代码
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	全空格	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
ExpirationDays	期限	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
CashOrderQty	现金金额	换出金额	填 0.0000	换出金额	换出金额
Memo	备注	备注	备注	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	换券个数	填 0	换券个数	换券个数
→ UnderlyingSecurityID	证券代码	证券代码	无此字段	证券代码	证券代码
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	固定填 102	无此字段	固定填 102	固定填 102
→ DeliveryQty	数量	数量	无此字段	数量	数量
→ DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	若为换入，则填 1， 若为换出，则填 2	无此字段	若为换入，则填 1，若为换出，则填 2	若为换入，则填 1，若为换出，则填 2
→ ShareProperty	股份性质	00、01	无此字段	00、01	00、01

		00=无限售流通股				
		01=首发后限售股				

表 4- 5 Binary 接口解除质押委托消息定义

域名	字段描述	正回购方成交请求字段取值	正回购方主动撤单委托字段取值	逆回购方点击成交申报（同意成交）字段取值	逆回购方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003				
ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购
SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方交易单元相同	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳	01=中国结算	01=中国结算	01=中国结算

		分公司	深圳分公司	深圳分公司	深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
LastPx	价格	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000

LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1035=解除质押	1035=解除质押	1035=解除质押	1035=解除质押
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购申报方营业部代码	逆回购方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易	逆回购方交易	逆回购方交易

			商代码	商代码	商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易	正回购方交易	正回购方交易

			主体代码	主体代码	主体代码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	逆回购方交易员代 码	逆回购方交易 员代码	正回购方交易 员代码	正回购方交易 员代码
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交 易编号	全空格	对应初始交易 的交易编号	对应初始交易 的交易编号
ExpirationDays	期限	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
CashOrderQty	现金金额	解除质押结算金额	填 0.0000	解除质押结算 金额	解除质押结算 金额
Memo	备注	备注	备注	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	填 0	填 0	填 0	填 0

表 4- 6 Binary 接口到期购回消息定义

域名	字段描述	到期购回字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=103003	
ApplID	应用标识	300=债券质押式协议 回购

SubmittingPBUID	申报交易单元，需与本方交易单元相同	申报交易单元
SecurityID	证券代码	全空格
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格
OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	固定填 0
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交	1

	报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	全空格
LastPx	价格	填 0.0000
LastQty	数量	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1032=到期购回
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	固定填 0
ConfirmID	约定号	全空格
Side	本方参与人买卖方向	2=正回购方
PBUID	本方交易单元	正回购方交易单元
AccountID	本方证券账户	正回购方证券账户
BranchID	本方营业部代码	正回购方营业部代码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格

CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格
MemberID	本方交易商代码	正回购方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	正回购方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	正回购方交易主体代码
InvestorName	本方客户名称	全空格
TraderCode	本方交易员代码	正回购方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	全空格
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	全空格
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	全空格
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	全空格
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	全空格
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号
ExpirationDays	期限	固定填 0

CashOrderQty	现金金额	填 0.0000
Memo	备注	备注
NoSecurity	质押券个数	填 0

说明:

(1) TradeReportID (客户成交申报编号) 在同一交易单元同一个交易日内不得重复。

(2) Memo (备注) 字段可由交易双方自行约定填写与本次交易相关的内容。

(3) 对于初始交易、提前购回和到期续做, LastPx (价格) 应大于 0, 其含义为年化利率, 单位为百分号, 即, 若填写 LastPx 为 6.0000 代表年化利率为 6.0000%。

(4) TrdMatchID (交易编号) 为 16 位字符串, 由交易所生成且跨交易日唯一, 交易系统对于每个初始交易达成的合约都会生成一个跨交易日唯一的交易编号, 填入到成交确认消息的 TrdMatchID (交易编号) 字段并发送给正、逆回购方, 到期购回、提前购回、解除质押、到期续做、质押券变更申报时应填写对应应在途合约的交易编号。到期续做不改变在途合约的交易编号。

(5) CashOrderQty (现金金额) 应为 0.01 元的整数倍。对于初始交易, CashOrderQty 必须大于 0, 且小于等于标的证券数量与面值的乘积; 债券面值可通过证券信息 securities.xml 中的面值 (ParValue) 字段获得。对于到期续做, CashOrderQty 必须大于 0, 且小于等于所有已质押券的证券数量与面值乘积的加和, 其含义为续做金额, 即续做的融资金额; 对于解除质押, CashOrderQty 必须大于等于 0。

(6) 对于初始交易、到期续做, ExpirationDays (回购天数) 应当为[1,365]区间内的任意整数, 且不得超过质押债券的存续期间; 质押债券的存续期可通过证券信息 securities.xml 中的债券到期日 (MaturityDate) 字段获得。对于到期购回、质押券变更、提前购回、解除质押, ExpirationDays (回购天数) 应当填 0。

(7) 对于到期续做 (不变更续做对手方), TrdSubType 应当为 10; 对于到期续做 (变更续做对手方), TrdSubType 应当为 11; 其他情况应当填 0。

(8) 到期续做 (不变更续做对手方)、提前购回、质押券变更、解除质押的正回购方、逆回购方的交易单元、交易商代码、交易主体类型、交易主体代码、证券账户必须与对应的在途合约一致。到期购回、到期续做 (变更续做对手方) 的正回购方交易单元、交易商代码、交易主体类型、交易主体代码、证券账户必须与对应应在途合约的正回购方一致。

(9) 到期购回不允许主动撤单，其他类型（初始交易、提前购回、到期续做、质押券变更、解除质押）的申报均允许主动撤单，但仅可在逆回购方确认或拒绝之前主动撤单。

(10) 正、逆回购方的委托需满足以下匹配条件，才能成交：

要素	检查方法	初始交易	到期续做	提前购回	质押券变更	解除质押
本方交易商代码 (MemberID)	等于待匹配委托的对手方交易商代码 (Counterparty MemberID)	✓	✓	✓	✓	✓
本方交易主体类型 (InvestorType)	等于待匹配委托的对手方交易主体类型 (Counterparty InvestorType)	✓	✓	✓	✓	✓
本方交易主体代码 (InvestorID)	等于待匹配委托的对手方交易主体代码 (Counterparty InvestorID)	✓	✓	✓	✓	✓
本方交易员代码 (TraderCode)	等于待匹配委托的对手方交易员代码 (TraderCode)	✓	✓	✓	✓	✓
价格 (LastPx)	一致	✓	✓	✓	×	×
成交申报业务类别 (TrdType)	一致	✓	✓	✓	✓	✓
成交申报业务子类别 (TrdSubType)	一致	×	✓	×	×	×
买卖方向 (Side)	回购方向相反	✓	✓	✓	✓	✓
交易编号 (TrdMatchId)	一致	×	✓	✓	✓	✓
期限 (ExpirationDays)	一致	✓	✓	×	×	×
现金金额 (CashOrderQty)	一致	✓	✓	×	✓	✓
质押券个数 (NoSecurity)	一致	✓	×	×	✓	×
质押券重复组	除顺序外一致	✓	×	×	✓	×

其中，质押券重复组包含的字段为证券代码 (UnderlyingSecurityID)、证券代码源 (UnderlyingSecurityIDSource)、数量 (DeliveryQty)、方向 (DeliverySide)、

股份性质 (ShareProperty)。

(11) NoSecurity (质押券个数) 字段的为重复组中包含的质押、解押证券的记录数。对于初始交易委托, 有且只能有一条 DeliverySide 为“质押”的记录; 对于质押券变更委托, DeliverySide 为“质押”的记录最多只能有一条, DeliverySide 为“解押”的记录最多只能有一条, 如果指定了质押券或解押券 (NoSecurity>0) 则不能同时指定换出金额 (CashOrderQty 必须为 0); 对于提前购回、到期购回、到期续做、解除质押委托, NoSecurity (质押券个数) 需等于 0。

(12) 到期购回和到期续做只能在回购到期日当天申报, 若到期日为非交易日, 则只能在到期日的下一个交易日申报。提前购回、质押券变更只能在回购到期日之前 (不含回购到期日、不含初始交易成交日) 申报。解除质押只能在回购到期日之后 (不含回购到期日) 申报, 若到期日为非交易日, 则只能在到期日的下一个交易日之后 (不含回购到期日的下一个交易日) 申报。举例说明, 某合约到期日为 20180512 日 (周六), 则在 20180512 日之前可以申报提前购回、质押券变更委托, 在 20180514 日 (到期日的下一交易日) 可申报到期购回和到期续做委托, 下 20180514 日之后的交易日 (不包含 20180514 日) 可申报解除质押委托。

(13) 对于未到期合约, 如果正回购方已提交了合法的提前购回委托, 则正回购方不能继续申报质押券变更委托或者再次提交提前购回委托。如果逆回购方拒绝了该笔提前购回委托或正回购方对该笔提前购回委托主动撤单成功, 则正回购方可以继续申报质押券变更委托以及再次提交提前购回委托。

(14) 对于当日到期的合约, 如果正回购方提交的到期购回委托已成交确认, 则正回购方不能继续申报到期续做委托或者再次提交到期购回委托。

(15) 对于当日到期的合约, 如果正回购方已提交了合法的到期续做委托, 则正回购方不能继续提交到期购回委托或者再次提交到期续做委托。如果逆回购方拒绝了该笔到期续做委托或正回购方对该笔到期续做委托主动撤单成功, 则正回购方可以继续申报到期购回委托以及再次提交到期续做委托。

(16) 对于已逾期的合约, 如果正回购方已提交了合法的解除质押委托, 则正回购方不能再次提交解除质押委托。如果逆回购方拒绝了该笔解除质押委托或正回购方对该笔解除质押委托主动撤单成功, 则正回购方可以再次提交解除质押委托。

(17) 质押券重复组中的数量 (DeliveryQty) 字段的单位为百元发行面额, 即, 如果某只质押券的质押数量为 20 万元发行面额, 则数量 (DeliveryQty) 字段填 2000.00。

(18) 对于支持使用首发后限售股份进行协议回购的质押券, 重复组中对应的股份性质 (ShareProperty) 字段可填写为 00 或 01, 否则股份性质 (ShareProperty) 字段固定为 00。

4.2 STEP 接口委托申报

表 4- 7 STEP 接口初始交易委托消息定义

Ta g	域名	字段描述	正回购方成交请求字 段取值	正回购方主动撤单委托 字段取值	逆回购方点击成交 申报（同意成交）字段 取值	逆回购方点击成交申 报（拒绝成交）字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回 购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回 购	300=债券质押式协议回 购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	1031=初始交易	1031=初始交易	1031=初始交易	1031=初始交易
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成	3	3	3	3

		交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求				
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	不需要填写	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>						
48	SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
组件结束						
组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码 申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致

	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	NoSides		side 个数	1	1	1	1
→	54	Side	买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
	组件<Parties>						
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8
	→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
		448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户
		447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	不需要填写
		452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	不需要填写
		448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码

		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
		448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角色	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码
		448	PartyID	参与人代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码
		子组件< PrysSubGrp>						
		802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	1
		→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
			523	PartySubID	参与方子代码	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	逆回购方客户名称 当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写逆方客户名称; 否则不需要填写
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需	逆回购方客户名称 当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名

				称”； 否则不需要填写	要填写	称”； 否则不需要填写	
组件结束							
448	PartyID		参与人代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码角色	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole		参与人代码角色	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码角色	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码
子组件< PtySubGrp>							
802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1	1	1
→	523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
组件结束							
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码角色	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码
组件结束							

组件结束							
31	LastPx		价格	年化利率，单位为百分比，取值范围： (0.0000,99.9900】且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	年化利率，单位为百分比，取值范围： (0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍	年化利率,单位为百分比，取值范围： (0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍
32	LastQty		数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
152	CashOrderQty		现金金额	初始成交金额	不需要填写	初始成交金额	初始成交金额
664	ConfirmID		约定号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8911	ExpirationDays		期限，单位为天数	期限	不需要填写	期限	期限
10198	Memo		备注	备注	备注	备注	备注
组件<CompDeliverSecurity>							
8902	NoSecurity		质押券个数	质押券个数	0	质押券个数	质押券个数
→	309	UnderlyingSecurityID	证券代码	质押券证券代码	不需要填写	质押券证券代码	质押券证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	固定填 102	102	不需要填写	102	102
→	8903	DeliveryQty	数量	质押券数量	不需要填写	质押券数量	质押券数量
→	10195	DeliverySide	方向	1	不需要填写	1	1

			1=质押 2=解押				
→	8908	SharePropertyType	股份性质 00=无限售流通股 01=首发后限售股	00、01	不需要填写	00、01	00、01
组件结束							

表 4- 8 STEP 接口到期续做委托消息定义

Tag	域名	字段描述	正回购方成交请求 字段取值	正回购方主动撤单委 托字段取值	逆回购方点击成交申报 (同意成交) 字段取值	逆回购方点击成交申 报 (拒绝成交) 字段取 值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议 回购	300=债券质押式协议回 购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回 购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	1033=到期续做	1033=到期续做	1033=到期续做	1033=到期续做

829	TrdSubType	成交申报业务子类别 10=不变更续做对手方 11=变更续做对手方	10、11	10、11	10、11	10、11
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交请求	3	3	3	3
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成交申报的客户成交申报编号	不需要填写	被撤委托的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发成交申报的客户成交申报编号
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>						

48	SecurityID		证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
组件结束							
组件<RootParties>							
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码	申报方交易单元， 需与本方交易单元 一致	申报方交易单元，需与 本方交易单元一致	申报方交易单元，需与本方交 易单元一致	申报方交易单元，需与 本方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者 标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标 识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	01=中国结算深圳 分公司	01=中国结算深圳分公 司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公 司
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	NoSides		side 个数	1	1	1	1
→	54	Side	买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	2=逆回购方

组件<Parties>							
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	10	10	10	9	
→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
	448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	不需要填写
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	不需要填写
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	不需要填写
	448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码	逆回购方营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码

		452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码
		子组件< PrysSubGrp>						
		802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	1
		→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
			523	PartySubID	参与方子代码	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	逆回购方客户名称 当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写逆方客户名称; 否则不需要填写
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写	逆回购方客户名称 当逆回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写
			组件结束					
		448	PartyID	参与人代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码

	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码
	448	PartyID	参与人代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码
	子组件< PtysSubGrp>						
	802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1	1	1	1
	→	523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
	组件结束						
	448	PartyID	参与人代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码

组件结束						
组件结束						
31	LastPx	价格	年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900】且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900】且必须为 0.01 的整数倍	年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900】且必须为 0.01 的整数倍
32	LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
152	CashOrderQty	现金金额	续做金额	不需要填写	续做金额	续做金额
664	ConfirmID	约定号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8911	ExpirationDays	期限，单位为天数	续做期限	不需要填写	续做期限	续做期限
880	TrdMatchID	初始交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
10198	Memo	备注	备注	备注	备注	备注

表 4- 9 STEP 接口提前购回委托消息定义

Tag	域名	字段描述	正回购方成交请求字段取值	正回购方主动撤单委托字段取值	逆回购方点击成交申报（同意成交）字段取值	逆回购方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
-----	----	------	--------------	----------------	----------------------	----------------------

	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	1034=提前购回	1034=提前购回	1034=提前购回	1034=提前购回
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交	3	3	3	3

		请求					
572	TradeReportRefID		原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式，逆 回购方填写转发成交 申报的客户成交申报 编号	不需要填写	被撤委托的客户成交申报 编号	填逆回购方接收的转发成 交申报的客户成交申报编 号	填逆回购方接收的转发成 交申报的客户成交申报编 号
60	TransactTime		成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>							
48	SecurityID		证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
组件结束							
组件<RootParties>							
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码	申报方交易单元，需 与本方交易单元一致	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者 标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	01=中国结算深圳分 公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司

	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	NoSides		side 个数	1	1	1	1
→	54	Side	买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
	组件<Parties>						
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8
	→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
		448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户
		447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号
		452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
		448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
		448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识

				标识		
452	PartyRole		参与人代码角色	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码
448	PartyID		参与人代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码角色	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码
子组件< PtysSubGrp>						
802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1	1
→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
组件结束						
448	PartyID		参与人代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole		参与人代码角色	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole		参与人代码角色	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码

	452	PartyRole		参与人代码角色	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码
	子组件< PtysSubGrp>							
	802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1	1	1
	→	523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
	组件结束							
	448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
	447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole		参与人代码角色	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码
	组件结束							
组件结束								
31	LastPx			价格	提前购回的年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍	填 0.0000	提前购回的年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍	提前购回的年化利率，单位为百分比，取值范围：(0.0000,99.9900 】且必须为 0.01 的整数倍
32	LastQty			数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00

664	ConfirmID	约定号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
880	TrdMatchID	初始交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	不需要填写	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
10198	Memo	备注	备注	备注	备注	备注

表 4- 10 STEP 接口质押券变更委托消息定义

Tag	域名	字段描述	正回购方成交请求字段取值	正回购方主动撤单委托字段取值	逆回购方点击成交申报（同意成交）字段取值	逆回购方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	1036=质押券变更	1036=质押券变更	1036=质押券变更	1036=质押券变更
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	0	0	2	3

487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配 对 3= One-Party Report for Pass Through, 成交 请求	3	3	3	3
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆 回购方填写转发成交 申报的客户成交申报 编号	不需要填写	被撤委托的客户成交申报 编号	填逆回购方接收的转发成交 申报的客户成交申报编号	填逆回购方接收的转发 成交申报的客户成交申 报编号
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>						
48	SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
组件结束						

组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	2	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码	申报方交易单元，需 与本方交易单元一致	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致	申报方交易单元，需与本 方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者 标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	01=中国结算深圳分 公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束						
组件<TrdCapRptSideGrp>						
552	NoSides		side 个数	1	1	1
→	54	Side	买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方
	组件<Parties>					
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	8
	→	448	PartyID	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元
		447	PartyIDSource	C=通用市场参与者 标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
		452	PartyRole	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元

448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	不需要填写
447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	不需要填写
452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	不需要填写
448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码	逆回购方营业部代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole	参与人代码角色	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码
子组件< PtysSubGrp>						
802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1	1	1	1
→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
组件结束						
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码

	452	PartyRole		参与人代码角色	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码
	448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码
	447	PartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole		参与人代码角色	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码
	448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码
	447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole		参与人代码角色	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码
	子组件< PrysSubGrp>							
	802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1	1	1
		523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
	组件结束							
	448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
	447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole		参与人代码角色	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码
	组件结束							
组件结束								

31	LastPx	价格	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
32	LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
152	CashOrderQty	现金金额	换出金额, 若为 0 则不需要填写	不需要填写	换出金额, 若为 0 则不需要填写	换出金额, 若为 0 则不需要填写
664	ConfirmID	约定号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
880	TrdMatchID	初始交易编号, 跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	不需要填写	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
10198	Memo	备注	备注	备注	备注	备注
组件<CompDeliverSecurity>						
8902	NoSecurity	质押券个数	换券个数	不需要填写	换券个数	换券个数
→	309	UnderlyingSecurityID	证券代码	质押券、解押券证券代码	不需要填写	质押券、解押券证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	固定填 102	固定填 102	不需要填写	固定填 102
→	8903	DeliveryQty	数量	数量	不需要填写	数量
→	10195	DeliverySide	方向 1=质押	1、2	不需要填写	1、2

			2=解押				
→	8908	SharePropertyType	股份性质 00=无限售流通股 01=首发后限售股	00、01	不需要填写	00、01	00、01
组件结束							

表 4- 11 STEP 接口解除质押委托消息定义

Tag	域名	字段描述	正回购方成交请求 字段取值	正回购方主动撤单委 托字段取值	逆回购方点击成交申报 (同意成交) 字段取值	逆回购方点击成交 申报(拒绝成交) 字段 取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回 购	300=债券质押式协议回 购	300=债券质押式协议回购	300=债券质押式协议 回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型
828	TrdType	成交申报业务类别	1035=解除质押	1035=解除质押	1035=解除质押	1035=解除质押
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报	0	0	2	3

		2=接受成交申报 3=拒绝成交申报				
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0	1	2	2
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配 对 3= One-Party Report for Pass Through, 成 交请求	3	3	3	3
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成 交申报的客户成交申 报编号	不需要填写	被撤委托的客户成交申报 编号	填逆回购方接收的转发成 交申报的客户成交申报编 号	填逆回购方接收的转 发成交申报的客户成 交申报编号
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>						
48	SecurityID	证券代码	全空格	全空格	全空格	全空格

22	SecurityIDSource			证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格	全空格	全空格	全空格
组件结束								
组件<RootParties>								
1116	NoRootPartyIDs			参与人代码个数	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID		参与人代码	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致	申报方交易单元, 需与本方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
	1117	RootPartyID		参与人代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束								
组件<TrdCapRptSideGrp>								
552	NoSides			side 个数	1	1	1	1
→	54	Side		买卖方向	2=正回购方	2=正回购方	1=逆回购方	1=逆回购方
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	9	9	9	8
	→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易单元	正回购方交易单元	逆回购方交易单元	逆回购方交易单元

447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户	正回购方证券账户	逆回购方证券账户	不需要填写
447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	不需要填写
452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	不需要填写
448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码	正回购方营业部代码	逆回购方营业部代码	逆回购方营业部代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole	参与人代码角色	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码	7: 交易商代码
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码	4003: 交易主体代码
子组件< PrysSubGrp>						
802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1	1	1	1
→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型

			组件结束								
448	PartyID		参与人代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码				
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码				
452	PartyRole		参与人代码角色	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码	36: 交易员代码				
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交易商代码				
447	PartyIDSource		参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识				
452	PartyRole		参与人代码角色	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码	20: 对手方交易商代码				
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码				
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码				
452	PartyRole		参与人代码角色	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码	4004: 对手方交易主体代码				
			子组件< PrysSubGrp>								
802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	1	1	1	1				
→	523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型				
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型				
			组件结束								
448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码				
447	PartyIDSource		参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码				
452	PartyRole		参与人代码角色	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码	37: 对手方交易员代码				
			组件结束								

组件结束						
31	LastPx	价格	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
32	LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
152	CashOrderQty	现金金额	解除质押结算金额	不需要填写	解除质押结算金额	解除质押结算金额
664	ConfirmID	约定号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
880	TrdMatchID	初始交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号	不需要填写	对应初始交易的交易编号	对应初始交易的交易编号
10198	Memo	备注	备注	备注	备注	备注

表 4- 12 STEP 接口到期回购委托消息定义

Tag	域名	字段描述	正回购方到期回购字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE	
1180	ApplID	应用标识	300=债券质押式协议回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户成交申报编号
522	OwnerType	订单所有者类型 1=个人投资者发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起	订单所有者类型

828	TrdType	成交申报业务类别	1032=到期购回
856	TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报 2=接受成交申报 3=拒绝成交申报	固定填 0
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel 2=Replace	0
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party Report For Matching, 协议配 对 3= One-Party Report for Pass Through, 成 交请求	1
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用 对于成交请求模式, 逆回购方填写转发成 交申报的客户成交申 报编号	不需要填写
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间

组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	全空格
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	全空格
组件结束			
组件<RootParties>			
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码 申报方交易单元，需与本 方交易单元一致
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源 C=通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色 1=申报交易单元
	1117	RootPartyID	参与人代码 01=中国结算深圳分公司
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源 F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色 4=结算机构代码
组件结束			
组件<TrdCapRptSideGrp>			
552	NoSides	side 个数	1
→	54	Side	买卖方向 2=正回购方
	组件<Parties>		
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数 6

→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元
	448	PartyID	参与人代码	正回购方证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号
	452	PartyRole	参与人代码角色	5=投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	正回购方营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易商代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	7: 交易商代码
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4003: 交易主体代码
	子组件< PrysSubGrp>			
	802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1
	→	523	PartySubID	参与方子代码
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交易员代码

		447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	36: 交易员代码
	组件结束				
组件结束					
31	LastPx			价格	填 0.0000
32	LastQty			数量	填 0.00
880	TrdMatchID			初始交易编号，跨交易日唯一	对应初始交易的交易编号

说明：字段取值参见 Binary 接口说明部分。

五、转发成交申报

转发成交申报是由交易系统生成的回报类报文。交易系统在如下四种情形下会生成转发成交申报报文：

情形一：接收到正回购方发起的成交请求申报后，交易系统生成转发成交申报报文并发送给逆回购方；

情形二：接收到逆回购方合法的点击成交申报且成交申报类型为“3=拒绝成交申报”后，交易系统生成转发成交申报报文并发送给正回购方，通知正回购方已发起的成交请求申报被逆回购方拒绝；

情形三：接收到正回购方发起的成交报告模式下的成交申报后，交易系统生成转发成交申报报文并发送给逆回购方。

情形四：成交请求模式下，在逆回购方确认或拒绝之前，接收到正回购方合法的成交请求主动撤单委托，交易系统生成对应的转发主动撤单报文并发送给逆回购方。

情形五：到期续做变更对手方时，在续做成交达成之后，交易系统会生成一笔原合约到期购回的转发成交申报报文并发送给原逆回购方。

如下 Binary、STEP 取值描述中原委托特指发起方的成交申报委托，在情形一、三、情形四、情形五中指正回购方的成交申报，情形二中指逆回购方的成交申报。

5.1 Binary 接口转发成交申报

表 5- 1 Binary 接口转发成交申报消息定义

域名	字段描述	情形 一字段 取值	情形 二字段 取值	情形 三字段 取值	情形 四字段 取值	情形 五字段 取值
Standard Header	消息头 MsgType=203020					
ReportIndex	回报记录号					
ApplID	应用标识	300: 债 券质押 式协议 回购	300: 债 券质押 式协议 回购	300: 债 券质押 式协议 回购	300: 债 券质押 式协议 回购	300: 债 券质押 式协议 回购

ReportingPBUID	回报交易单元	参见说明 (1)	参见说明 (1)	参见说明 (1)	参见说明 (1)	参见说明 (1)
SubmittingPBUID	申报交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
SecurityID	证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源
OwnerType	订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型	原委托的订单所有者类型
ClearingFirm	结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码	原委托的结算机构代码
TransactTime	回报时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间
UserInfo	用户私有信息	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
TradeID	交易所成交申报编号	原委托成交申报响应中的交易所成交申报编号	被拒绝的正回购方委托成交申报响应中的交易所成交申报编号	原委托成交申报响应中的交易所成交申报编号	被撤委托成交申报响应中的交易所成交申报编号	原委托成交申报响应中的交易所成交申报编号
TradeReportID	客户成交申报编号	交易系统生成编号, 当日唯一, 当广播发送时, 客户端需根据本字段	正回购方对应委托的客户成交申报编号	交易系统生成编号, 当日唯一	交易系统生成编号, 当日唯一	交易系统生成编号, 当日唯一

		去重后 展示				
TradeReportType	成交申报类型	1	3	0	1	0
TradeReportTransType	成交申报事务类别	原委托 的成交 申报事 务类别	1	原委托 的成交 申报事 务类别	原委托 的成交 申报事 务类别	原委托 的成交 申报事 务类别
TradeHandlingInstr	成交申报模式	原委托 的成交 申报模 式	原委托 的成交 申报模 式	原委托 的成交 申报模 式	原委托 的成交 申报模 式	原委托 的成交 申报模 式
TradeReportRefID	原客户成交申报 编号	全空格	全空格	全空格	填交易 系统生 成的与 原被撤 转发成 交申报 对应的 唯一编 号	全空格
LastPx	价格	原委托 的价格	原委托 的价格	原委托 的价格	原委托 的价格	0.0000
LastQty	数量	原委托 的数量	原委托 的数量	原委托 的数量	原委托 的数量	0.00
TrdType	成交申报业务类别	原委托 的成交 申报业 务类别	原委托 的成交 申报业 务类别	原委托 的成交 申报业 务类别	原委托 的成交 申报业 务类别	1032= 到期购 回
TrdSubType	成交申报业务子 类别 预留	原委托 的成交 申报业 务子类 别	原委托 的成交 申报业 务子类 别	原委托 的成交 申报业 务子类 别	原委托 的成交 申报业 务子类 别	0
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
ExecID	执行编号	交易系 统生成	交易系 统生成	交易系 统生成	交易系 统生成	交易系 统生成

		的当日 唯一编 号	的当日 唯一编 号	的当日 唯一编 号	的当日 唯一编 号	的当日 唯一编 号
Side	本方参与人买卖 方向	原委托 的买卖 方向	原委托 的买卖 方向	原委托 的买卖 方向	原委托 的买卖 方向	原委托 的买卖 方向
PBUID	本方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
AccountID	本方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
BranchID	本方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CounterpartyBranchID	对手方营业部代 码	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
MemberID	本方交易商代码	原委托 的本方 交易商 代码	原委托 的本方 交易商 代码	原委托 的本方 交易商 代码	原委托 的本方 交易商 代码	原委托 的本方 交易商 代码
InvestorType	本方交易主体类 型	原委托 的本方 交易主 体类型	原委托 的本方 交易主 体类型	原委托 的本方 交易主 体类型	原委托 的本方 交易主 体类型	原委托 的本方 交易主 体类型
InvestorID	本方交易主体代 码	原委托 的本方 交易主 体代码	原委托 的本方 交易主 体代码	原委托 的本方 交易主 体代码	原委托 的本方 交易主 体代码	原委托 的本方 交易主 体代码
InvestorName	本方客户名称	原委托 的本方	原委托 的本方	原委托 的本方	原委托 的本方	原委托 的本方

		交易客 户名称	交易客 户名称	交易客 户名称	交易客 户名称	交易客 户名称
TraderCode	本方交易员代码	原委托 的本方 交易员 代码	原委托 的本方 交易员 代码	原委托 的本方 交易员 代码	原委托 的本方 交易员 代码	原委托 的本方 交易员 代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代 码	原委托 的对手 方交易 商代码	原委托 的对手 方交易 商代码	参见说 明（3）	原委托 的对手 方交易 商代码	参见说 明（3）
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体 类型	原委托 的对手 方交易 主体类 型	原委托 的对手 方交易 主体类 型	参见说 明（3）	原委托 的对手 方交易 主体类 型	参见说 明（3）
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体 代码	原委托 的对手 方交易 主体代 码	原委托 的对手 方交易 主体代 码	参见说 明（3）	原委托 的对手 方交易 主体代 码	参见说 明（3）
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	原委托 的对手 方交易 客户名	原委托 的对手 方交易 客户名	原委托 的对手 方交易 客户名	原委托 的对手 方交易 客户名	原委托 的对手 方交易 客户名

		称	称	称	称	称
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	原委托的对手方交易员代码	原委托的对手方交易员代码	参见说明（3）	原委托的对手方交易员代码	参见说明（3）
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号
ExpirationDays	期限，单位为天数	原委托的期限	原委托的期限	原委托的期限	原委托的期限	0
CashOrderQty	现金金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	0.0000
Memo	备注	原委托的备注	全空格	全空格	原委托的备注	全空格
SettlCurrAmt	结算金额	填0.0000	填0.0000	参见说明（2）	填0.0000	参见说明（2）
NoSecurity	质押券个数	参见说明（4）	原委托的质押券个数	原委托的质押券个数	原委托的质押券个数	0
→	UnderlyingSecurityID	证券代码	参见说明（4）	原委托的证券代码	原委托的证券代码	不涉及
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	参见说明（4）	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	不涉及

→	DeliveryQty	数量	参见说明（4）	原委托的数量	原委托的数量	原委托的数量	不涉及
→	DeliverySide	方向	参见说明（4）	原委托的方向	原委托的方向	原委托的方向	不涉及
→	SharePropertyType	股份性质	参见说明（4）	原委托的股份性质	原委托的股份性质	原委托的股份性质	不涉及

说明：

（1）ReportingPBUID（回报交易单元），在情形一、情形四下，当成交申报类型为初始交易、到期续做且变更续做对手方时，填写为原委托对手方交易商代码下已报备的接收转发消息的交易单元，如果该交易商报备了多个接收转发消息的交易单元，则对应于每个交易单元都会生成一笔转发成交申报并发送给对手方，这些转发成交申报除 ReportingPBUID（回报交易单元）字段、ExecID（执行编号）外，其他字段的数据均一致；当成交申报类型为质押券变更、提前购回、解除质押、质押券变更且不变更对手方的时候，填写为在途合约对应的逆回购方交易单元，即，最近一次初始交易或到期续做达成成交时逆回购方使用的本方交易单元；在情形二下，填写为被拒绝的正回购方对应委托的申报交易单元；在情形三下，当成交申报类型为到期购回时，填写为在途合约对应的逆回购方交易单元；在情形五下，填写为原合约的逆回购方交易单元。

（2）在情景五或 TrdType（成交申报业务类别）为 1034=提前购回、1032=到期购回、1033=到期续做且不变更续做对手方时，SettlCurrAmt（结算金额）字段需填写交易系统计算的到期结算金额（本金+利息）；其它填 0.0000。

（3）情形三、情形五下，CounterpartyMemberID（对手方交易商代码）、CounterpartyInvestorType（对手方交易主体类型）、CounterpartyInvestorID（对手方交易主体代码）、CounterpartyTraderCode（对手方交易员代码）填写为合约达成时的逆回购方交易商代码、逆回购方交易主体类型、逆回购方交易主体代码、逆回购方交易员代码，合约达成时指初始交易或最近一次续做。

(4) 当 TrdType (成交申报业务类别) 为 1033=到期续做且变更续做对手方时, 交易系统会将本合约已质押券信息填充至 NoSecurity (质押券个数)、UnderlyingSecurityID (证券代码)、UnderlyingSecurityIDSource (证券代码源)、DeliveryQty (数量)、DeliverySide (方向)、ShareProperty (股份性质) 字段, 由于可以通过质押券变更补充同一证券不同股份属性的质押券, 因此已质押券信息中有可能存在相同 UnderlyingSecurityID (证券代码)、相同 UnderlyingSecurityIDSource (证券代码源)、但不同 ShareProperty (股份性质) 的多条记录; 其他情况下 NoSecurity (质押券个数)、UnderlyingSecurityID (证券代码)、UnderlyingSecurityIDSource (证券代码源)、DeliveryQty (数量)、DeliverySide (方向)、ShareProperty (股份性质) 字段与原委托一致。

5.2 STEP 接口转发成交申报

表 5- 2 STEP 接口转发成交申报消息定义

Tag	域名	字段描述	情形一字 段取值	情形二字 段取值	情形三字段取值	情形四字 段取值	情形五字 段取值
	MessageHeader	MsgType=AE					
10179	ReportIndex	回报记录号					
1180	ApplID	应用标识	300: 债券质 押式协议回 购	300: 债券质 押式协议回 购	300: 债券质押式协议回 购	300: 债券质 押式协议回 购	300: 债券质 押式协议回 购
1003	TradeID	交易所成交 申报编号	原委托成交 申报响应中 的交易所成 交申报编号	被拒绝的正 回购方委托 成交申报响 应中的交易 所成交申报 编号	原委托成交申报响应中 的交易所成交申报编号	被撤委托成 交申报响中 的交易所成 交申报编号	原委托成交 申报响应中 的交易所成 交申报编号
571	TradeReportID	客户成交申 报编号	交易系统生 成编号,当日 唯一	正回购方对 应委托的客 户成交申报 编号	交易系统生成编号, 当 日唯一	交易系统生 成编号, 当 日唯一	交易系统生 成编号,当日 唯一
522	OwnerType	成交申报所 所有者类型	原委托的订 单所有者类 型	原委托的订 单所有者类 型	原委托的订单所有者类 型	原委托的订 单所有者类 型	原委托的订 单所有者类 型

828	TrdType	成交申报业务类别	原委托的成交申报业务类别	原委托的成交申报业务类别	原委托的成交申报业务类别	原委托的成交申报业务类别	1032
856	TradeReportType	成交申报类型	1	3	0	1	0
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	原委托的成交申报事务类别	1	原委托的成交申报事务类别	原委托的成交申报事务类别	原委托的成交申报事务类别
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式	原委托的成交申报模式
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号	不需要填写	不需要填写	不需要填写	填交易系统生成的与原被撤转发成交申报对应的客户成交申报编号	不需要填写
60	TransactTime	回报时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间	转发成交申报生成时间
组件<Instrument>							
48	SecurityID	证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码	原委托的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证券代码源

组件结束								
组件<RootParties>								
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码 个数	2	2	2	2	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码	参见说明(1)	参 见 说 明 (1)	参见说明(1)	参 见 说 明 (1)	参见说明(1)
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码 源	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场 参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码 角色	27=回报交 易单元	27= 回 报 交 易单元	27=回报交易单元	27= 回 报 交 易单元	27=回报交易 单元
	1117	RootPartyID	参与人代码	01= 中 国 结 算深圳分公 司	01= 中 国 结 算深圳分公 司	01=中国结算深圳分公 司	01= 中 国 结 算深圳分公 司	01=中国结算 深圳分公司
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码 源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
	1119	RootPartyRole	参与人代码 角色	4=结算机构 代码	4=结算机构 代码	4=结算机构代码	4=结算机构 代码	4=结算机构 代码
组件结束								
组件<TrdCapRptSideGrp>								
552	NoSides		side 个数	1	1	1	1	
→	54	Side	买卖方向	2=正回购方	1=逆回购方	2=正回购方	2=正回购方	2=正回购方

组件<Parties>								
453	NoPartyIDs		参与人代码 个数	7	7	7	7	7
→	448	PartyID	参与人代码	正回购方交 易商代码	逆回购方交 易商代码	正回购方交易商代码	正回购方交 易商代码	正回购方交 易商代码
	447	PartyIDSource	参与人代码 源	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场 参与者标识	C=通用市场 参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码 角色	7=交易商代 码	7=交易商代 码	7=交易商代码	7=交易商代 码	7=交易商代 码
	448	PartyID	参与人代码	正回购方交 易主体代码	逆回购方交 易主体代码	正回购方交易主体代码	正回购方交 易主体代码	正回购方交 易主体代码
	447	PartyIDSource	参与人代码 源	D=表示自定 义代码	D=表示自定 义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定 义代码	D=表示自定 义代码
	452	PartyRole	参与人代码 角色	4003=表示交 易主体代码	4003=表示 交易主体代 码	4003=表示交易主体代 码	4003=表示 交易主体代 码	4003=表示交 易主体代码
	子组件< PtysSubGrp>							
	802	NoPartySubIDs	参与方子代 码个数	正回购方客 户名称 当正回购方 交易主体类 型为 03=机 构经纪时,填	逆回购方客 户名称 当逆回购方 交易主体类 型为 03=机 构经纪时,填	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类 型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	正回购方客 户名称 当正回购方 交易主体类 型为 03=机 构经纪时,填	正回购方客 户名称 当正回购方 交易主体类 型为 03=机 构经纪时,填

					2; 否则填 1	填 1; 否则不需要填写		填 2; 否则填 1	2; 否则填 1
		→	523	PartySubID	参与方子代码	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
			523	PartySubID	参与方子代码	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写	正回购方客户名称 当正回购方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写 “5=本方客户名称”; 否则不需要填写

组件结束							
448	PartyID	参与人代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码	正回购方交易员代码
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	12=表示交易员代码	12=表示交易员代码	12=表示交易员代码	12=表示交易员代码	12=表示交易员代码
448	PartyID	参与人代码	逆回购方交易商代码	正回购方交易商代码	逆回购方交易商代码, 参见说明(3)	逆回购方交易商代码	逆回购方交易商代码, 参见说明(3)
447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
452	PartyRole	参与人代码角色	20=交易商代码	20=交易商代码	20=交易商代码	20=交易商代码	20=交易商代码
448	PartyID	参与人代码	逆回购方交易主体代码	正回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码, 参见说明(3)	逆回购方交易主体代码	逆回购方交易主体代码, 参见说明(3)
447	PartyIDSource	参与人代码源	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码
452	PartyRole	参与人代码角色	4004=表示对手方交易主体代码	4004=表示对手方交易主体代码	4004=表示对手方交易主体代码	4004=表示对手方交易主体代码	4004=表示对手方交易主体代码
子组件< PrysSubGrp>							
802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1	1	1	1	1

		→	523	PartySubID	参与方子代码	逆回购方交易主体类型	正回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型，参见说明（3）	逆回购方交易主体类型	逆回购方交易主体类型，参见说明（3）
			803	PartySubIDType	参与方子代码类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型	26=交易主体类型
		子组件< PtysSubGrp>								
		448	PartyID		参与人代码	逆回购方交易员代码	正回购方交易员代码	逆回购方交易员代码，参见说明（3）	逆回购方交易员代码	逆回购方交易员代码，参见说明（3）
		447	PartyIDSource		参与人代码源	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码	D=表示自定义代码
		452	PartyRole		参与人代码角色	37=表示对手方交易员代码	37=表示对手方交易员代码	37=表示对手方交易员代码	37=表示对手方交易员代码	37=表示对手方交易员代码
		组件结束								
组件结束										
17	ExecID			执行编号	交易系统生成的当日唯一编号,客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号,客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成的当日唯一编号,客户端需根据本字段去重后展示	交易系统生成的当日唯一编号,客户端需根据本字段去重后展示	
31	LastPx			成交价格	原委托的价格	原委托的价格	原委托的价格	原委托的价格	0.0000	

32	LastQty	成交数量	原委托的数量	原委托的数量	原委托的数量	原委托的数量	0.00
152	CashOrderQty	金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	原委托的现金金额	0.0000
119	SettlCurrAmt	结算金额	不需要填写	不需要填写	参见说明(2)	不需要填写	参见说明(2)
8911	ExpirationDays	购回期限	原委托的期限	原委托的期限	原委托的期限	原委托的期限	0
880	TrdMatchID	初始交易编号, 跨交易日唯一	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号	原委托的交易编号
10198	Memo	备注	原委托的备注	全空格	全空格	原委托的备注	全空格
组件<CompDeliverSecurity>							
8902	NoSecurity	质押券个数	原委托的质押券个数	原委托的质押券个数	原委托的质押券个数	原委托的质押券个数	0
→	309	UnderlyingSecurityID	证券代码	参见说明(4)	原委托的证券代码	原委托的证券代码	不需要填写

→	305	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	参见说明(4)	原委托的证 券代码源	原委托的证券代码源	原委托的证 券代码源	不需要填写
→	8903	DeliveryQty	数量	参见说明(4)	原委托的数 量	原委托的数量	原委托的数 量	不需要填写
→	10195	DeliverySide	方向	参见说明(4)	原委托的方 向	原委托的方向	原委托的方 向	不需要填写
→	8908	ShareProperty	股份性质	参见说明(4)	原委托的股 份性质	原委托的股份性质	原委托的股 份性质	不需要填写
组件结束								

说明：同 Binary 转发成交申报。

六、 成交申报响应

6.1 Binary 接口成交申报响应

表 6-1 Binary 接口成交申报响应消息定义

域名	字段描述	非主动撤单成交申报响应字段取值	主动撤单成功成交申报响应字段取值	主动撤单成功失败申报响应字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=203004			
ReportIndex	回报记录号			
ApplID	应用标识	300: 债券质押式协议回购	300: 债券质押式协议回购	300: 债券质押式协议回购
ReportingPBUID	回报交易单元	协议回购委托申报交易单元	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	协议回购委托申报交易单元	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报交易单元
SecurityID	证券代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TransactTime	回报时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间
UserInfo	用户私有信息	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TradeID	交易所成交申报编号	交易所为协议回购委托分配的唯一 ID	被撤单委托对应交易所成交申报编号	主动撤单委托申报对应字段值
TradeReportID	客户成交申报编号	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TradeReportType	成交申报类型	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值

TradeReportTransType	成交申报事务类别	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TradeHandlingInstr	成交申报模式	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TrdAckStatus	成交申报响应状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受	1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	成交申报状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 100=Unmatched, 尚未匹配	2=Cancelled, 已撤销	如被撤委托存在则返回被撤委托状态, 否则返回 1 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 101=Matched, 已匹配
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代码	TrdAckStatus 为 1 时返回拒绝原因代码	0	撤单失败原因代码
LastPx	价格	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
LastQty	数量	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TrdType	成交申报业务类别	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
ConfirmID	约定号	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号
Side	本方参与人买卖	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值

	方向			值
PBUID	本方交易单元	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
AccountID	本方证券账户	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
BranchID	本方营业部代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
MemberID	本方交易商代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
InvestorType	本方交易主体类型	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
InvestorID	本方交易主体代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
InvestorName	本方客户名称	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
TraderCode	本方交易员代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值

				值
TrdMatchID	交易编号, 跨交易日唯一	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
ExpirationDays	期限, 单位为天数	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
CashOrderQty	现金金额	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
Memo	备注	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
SettlCurrAmt	结算金额	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
NoSecurity	质押券个数	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityID	证券代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
→ DeliveryQty	数量	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
→ DeliverySide	方向	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
→ ShareProperty	股份性质	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值

6.2 STEP 接口成交申报响应

表 6-2 STEP 接口成交申报响应消息定义

Tag	域名	字段描述	非主动撤单成交申报响应字段取值	主动撤单成功成交申报响应字段取值	主动撤单成功失败申报响应字段取值
	MessageHeader	MsgType=AR			
10179	ReportIndex	回报记录号			
1180	ApplID	应用标识	300: 协议回购	300: 协议回购	300: 协议回购

1003	TradeID		交易所为成交申报分配的唯一 ID	交易所为协议回购委托分配的唯一 ID	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
571	TradeReportID		客户成交申报编号	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
522	OwnerType		成交申报所有者类型	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
828	TrdType		成交申报业务类别	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
856	TradeReportType		成交申报类型	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
487	TradeReportTransType		成交申报事务类别	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
1123	TradeHandlingInstr		成交申报模式	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托对应字段值	主动撤单委托申报对应字段值
8912	TrdAckStatus		成交申报响应状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受	1=Rejected, 拒绝
939	TrdRptStatus		成交申报状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 100=Unmatched, 尚未匹配	2=Cancelled, 已撤销	如被撤委托存在则返回被撤委托状态, 否则返回 1 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝 2=Cancelled, 已撤销 101=Matched, 已匹配
751	TradeReportRejectReason		成交申报被拒绝原因代码	TrdAckStatus 为 1 时返回拒绝原因代码	0	撤单失败原因代码
60	TransactTime		回报时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间
组件<Instrument>						
48	SecurityID		证券代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
22	SecurityIDSource		证券代码源	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
组件结束						
组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
→	1117	RootPartyID	参与人代码	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值

	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	协议回购委托申报对应字段值	主动撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
组件结束								
组件<TrdCapRptSideGrp>								
552	NoSides			side 个数	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
→	54	Side		买卖方向	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
	→	448	PartyID		参与人代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
		447	PartyIDSource		参与人代码源	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
		452	PartyRole		参与人代码角色	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
		子组件< PtysSubGrp>						
	802	NoPartySubIDs		参与方子代码个数	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
	→	523	PartySubID		参与方子代码	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值
	组件结束							
	组件结束							
组件结束								
17	ExecID			执行编号	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号	交易系统生成的当日唯一编号	
31	LastPx			成交价格	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
32	LastQty			成交数量	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
152	CashOrderQty			金额	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	
664	ConfirmID			约定号	协议回购委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值	主动撤单委托申报对应值	

8911	ExpirationDays		购回期限	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
880	TrdMatchID		初始交易编 号, 跨交易日 唯一	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
10198	Memo		备注	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
组件<CompDeliverSecurity>						
8902	NoSecurity		质押券个数	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
→	309	UnderlyingSecurityID	证券代码	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
→	8903	DeliveryQty	数量	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
→	10195	DeliverySide	方向	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
→	8908	ShareProperty	股份性质	协议回购委托申报 对应字段值	被撤单委托申报 对应值	主动撤单委托申 报对应值
组件结束						

七、 成交确认

7.1 Binary 接口成交确认

表 7- 1 Binary 接口成交确认消息定义

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=203003	
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	300: 债券质押式 协议回购
ReportingPBUID	回报交易单元	协议回购委托申 报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	协议回购委托申 报交易单元
SecurityID	证券代码	协议回购委托申 报对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	协议回购委托申 报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	协议回购委托申

		报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	协议回购委托申报对应字段值
TransactTime	回报时间	成交确认生成时间
UserInfo	用户私有信息	协议回购委托申报对应字段值
TradeID	交易所成交申报编号	交易所为成交申报分配的唯一 ID
TradeReportID	客户成交申报编号	协议回购委托申报对应字段值
TradeReportType	成交申报类型	0
TradeReportTransType	成交申报事务类别	0
TradeHandlingInstr	成交申报模式	0
LastPx	价格	协议回购委托申报对应字段值
LastQty	数量	协议回购委托申报对应字段值
TrdType	成交申报业务类别	协议回购委托申报对应字段值
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	协议回购委托申报对应字段值
ConfirmID	约定号	协议回购委托申报对应字段值
ExecID	执行编号	交易系统生成的当日唯一编号
Side	本方参与者买卖方向	协议回购委托申报对应字段值
PBUID	本方交易单元	协议回购委托申报对应字段值
AccountID	本方证券账户	协议回购委托申报对应字段值
BranchID	本方营业部代码	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	协议回购委托申报对应字段值
MemberID	本方交易商代码	协议回购委托申报对应字段值

InvestorType	本方交易主体类型	协议回购委托申报对应字段值
InvestorID	本方交易主体代码	协议回购委托申报对应字段值
InvestorName	本方客户名称	协议回购委托申报对应字段值
TraderCode	本方交易员代码	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	协议回购委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	协议回购对手方委托申报对应InvestorName
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	协议回购委托申报对应字段值
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	参见说明（1）
ExpirationDays	期限，单位为天数	协议回购委托申报对应字段值
CashOrderQty	现金金额	协议回购委托申报对应字段值
Memo	备注	协议回购委托申报对应字段值
MaturityDate	回购到期日	回购到期日
SettlCurrAmt	结算金额	参见说明（2）
NoSecurity	质押券个数	协议回购委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityID	原委托的证券代码	协议回购委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityIDSource	原委托的证券代码源	协议回购委托申报对应字段值
→ DeliveryQty	原委托的数量	协议回购委托申报对应字段值
→ DeliverySide	原委托的方向	协议回购委托申报对应字段值
→ ShareProperty	原委托的股份性质	协议回购委托申报对应字段值

说明：

(1) TrdMatchID (交易编号) 为 16 位字符串, 由交易所生成且跨交易日唯一, 若为初始交易, 由交易系统生成, 其它与原协议回购委托的交易编号一致。

(2) SettlCurrAmt (结算金额), 若为到期购回、到期续做 (不变更续做对手方)、提前购回, 填交易系统计算的结算金额 (初始交易金额+利息), 对于多次续做场景, 初始交易金额为上一次续做合约的续做金额; 若为到期续做 (变更续做对手方), 给正回购方的成交确认中填交易系统计算的结算金额 (初始交易金额+利息), 给新的逆回购方的成交确认中填 0.0000; 若为解除质押, 填协议回购委托申报对应的现金金额 (CashOrderQty); 其它填 0.0000。

7.2 STEP 接口成交确认

表 7-2 STEP 接口成交确认消息定义

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE	
10179	ReportIndex	回报记录号	
1180	ApplID	应用标识	300: 债券质押式协议回购
1003	TradeID	交易所为成交申报分配的唯一 ID	
571	TradeReportID	客户成交申报编号	协议回购委托申报对应字段值
522	OwnerType	成交申报所有者类型	协议回购委托申报对应字段值
828	TrdType	成交申报业务类别	协议回购委托申报对应字段值
856	TradeReportType	成交申报类型	协议回购委托申报对应字段值
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	协议回购委托申报对应字段值
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	0
60	TransactTime	回报时间	成交申报响应生成时间
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	协议回购委托申报对应字段值

22	SecurityIDSource			证券代码源	协议回购委托申报对应字段值	
组件结束						
组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs			参与人代码个数	协议回购委托申报对应字段值	
→	1117	RootPartyID		参与人代码	协议回购委托申报对应字段值	
	1118	RootPartyIDSource		参与人代码源	协议回购委托申报对应字段值	
	1119	RootPartyRole		参与人代码角色	协议回购委托申报对应字段值	
组件结束						
组件<TrdCapRptSideGrp>						
552	NoSides			side 个数	协议回购委托申报对应字段值	
→	54	Side		买卖方向	协议回购委托申报对应字段值	
	组件<Parties>					
	453	NoPartyIDs			参与人代码个数	
	→	448	PartyID		参与人代码	
		447	PartyIDSource		参与人代码源	
		452	PartyRole		参与人代码角色	
	子组件< PtysSubGrp>					
	802	NoPartySubIDs			参与方子代码个数	
	→	523	PartySubID		参与方子代码	
		803	PartySubIDType		参与方子代码类型	
	组件结束					
	组件结束					
组件结束						
17	ExecID			执行编号		
31	LastPx			成交价格	协议回购委托申报	

			对应字段值
32	LastQty	成交数量	协议回购委托申报 对应字段值
152	CashOrderQty	金额	协议回购委托申报 对应字段值
664	ConfirmID	约定号	协议回购委托申报 对应字段值
8911	ExpirationDays	购回期限	协议回购委托申报 对应字段值
880	TrdMatchID	初始交易编 号, 跨交易日 唯一	参见说明 (1)
119	SettlCurrAmt	结算金额	参见说明 (2)
10198	Memo	备注	协议回购委托申报 对应字段值
组件<CompDeliverSecurity>			
8902	NoSecurity	质押券个数	协议回购委托申报 对应字段值
→	309	UnderlyingSecurityID	证券代码
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源
→	8903	DeliveryQty	数量
→	10195	DeliverySide	方向
→	8908	ShareProperty	股份性质
组件结束			

说明:

在初始交易、到期续做且变更对手方时, 会将对手方的客户名称填写到

PtysSubGrp 中, 具体填写情况如下:

情形描述	Parties 取值	NoPartySubIDs (802)	PartySubID (523)	PartySubID Type (803)
初始交易、到期 续做且变更续做 对手方的成交确 认, 对手方交易 主体类型为 03= 机构经纪时	PartyIDSource (447) = D (自 定义代码) PartyRole (452) = 4004 (对手方交易主 体代码)	2	对手方交易主体类型	26=交易主体类型
			对手方客户名称	5=客户名称

其余说明参见 Binary 部分的说明。

八、 清算和交收

详见附件一。

九、 开展债券质押式协议回购业务的券商系统注意事项

9.1 行情相关说明

债券质押式协议回购的证券基本资料已在证券信息 securities.xml 中挂牌,但购回交易时可能由于标的证券发生提前兑付而不在深交所交易系统挂牌;债券质押式协议回购委托、成交不会反映到行情信息中。

9.2 委托回报相关说明

可以通过交易网关或者交易终端申报委托和接收成交,交易网关可以接收到交易终端申报委托对应的成交,但交易终端无法接收到交易网关申报委托对应的成交。

9.3 关于客户委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标客户及业务风险属性,自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等客户委托渠道(可选择一种或多种渠道)中的相应前端系统,以支持债券质押式协议回购业务的委托指令录入。

9.4 关于券商柜台系统

✧ 向深交所申报各类委托前的风险前端控制

所有申报的数量、价格或金额等要素必须符合本所债券质押式协议回购交易相关业务规则。

证券公司应当实施相应的正回购方、逆回购方适当性管理,确保向深交所交易系统申报的证券账户均为合法、合规账户。

✧ 向交易系统申报委托

接受正回购方、逆回购方协议回购业务的委托指令后,按照数据接口规范所约

定的内容使用交易网关或交易终端向交易系统申报交易委托。

每次申报的合同序号不能重复(从交易网关申报委托的合同序号与使用交易终端申报委托的合同序号也不能重复),否则后送到交易系统的重单委托将被视为非法而直接丢弃。

◇ 对交易系统发送的回报消息的处理

接收到交易系统发送的转发成交申报后,券商技术系统应对请求编号(即转发成交申报中的客户成交申报编号(TradeReportID)字段)重复的消息去重、过滤后展示;对于所有转发成交申报都必须保证能够展示给指定的接收方,不可以展示给无关人员。特别的,对于转发成交申报的接收方是经纪客户时,券商系统需保证转发成交申报不会被广播至无关的经纪客户。

具体可参见“3.3.3 交易场景分析”一节。

十、 联系方式

技术咨询: 0755-88668679

业务咨询: 0755-88666570

附件一、债券质押式协议回购业务的结算数据接口修订说明

一、 结算数据接口修订

1.1 接口修订简要说明

深市债券质押式协议回购（以下简称“协议回购”）业务增加到期续做变更对手方、提前购回、解除质押、变更质押券功能，调整以后的业务类别如下：

业务类别	业务类别名称
XYCS	债券质押式协议回购初始交易
XYDQ	债券质押式协议回购到期购回
XYXZ	债券质押式协议回购到期续做 不变对手方
XYHY	债券质押式协议回购合约
XYXB	债券质押式协议回购到期续做 变更对手方
XYTG	债券质押式协议回购 提前购回
XYJZ	债券质押式协议回购 解除质押
XYBG	债券质押式协议回购 变更质押券

对于‘XYCS’、‘XYDQ’、‘XYXZ’业务，**对所有债券品种统一为 RTGS 模式**。新增的‘XYXB’及‘XYTG’业务对所有债券品种采用 RTGS 模式，‘XYJZ’及‘XYBG’业务采用 T+0 日末逐笔非担保交收。

初始交易时，结算系统将融资方的证券在融资方的托管单元上进行质押冻结。到期购回、**提前购回、解除质押**时，结算系统对质押的证券及孳息进行解除质押冻结。**变更质押券时，结算系统对于换入证券进行质押冻结，对于换出证券或资金进行解除质押冻结**。相关证券及孳息的冻结、解冻数据都会发送相应的‘DJBG’（冻结变更）、‘DJJX’（资金解冻）数据。此外，业务类别为‘DJ00’（冻结总股数）的数据记录中也包含协议回购质押冻结的证券数量。

使用 SJS MX0.DBF 和 SJSJG.DBF 分别表示债券质押式协议回购业务指令的逐笔清算和日终交收结果。

使用 SJSZJ.DBF 表示相关资金交收数据，业务类别同 SJSJG.DBF。

使用 SJSQS.DBF 表示相关资金清算汇总数据，业务类别同 SJSJG.DBF。

协议回购质押明细信息通过 SJSFW.DBF 中数据类别为‘11’的数据发送，**逆回购方质押明细通过数据类别‘13’的数据发送**。

SJS MX0.DBF、SJSJG.DBF、SJSQS.DBF、SJSFW.DBF 详细说明见下文。

1.2 清算明细库 SJSMX0.DBF

SJSMX0.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版）》（网址：<http://www.chinaclear.cn> 的“服务支持/接口规范/深圳市场”栏目）。

协议回购的初始交易、到期购回、到期续做**不变对手方**、到期续做**变更对手方**、**提前购回**、**解除质押**的逐笔清算采用 SJSMX0.DBF 中的‘XYCS’、‘XYDQ’、‘XYXZ’、‘XYXB’、‘XYTG’、‘XYJZ’业务类别。一笔在途的协议回购合约经过变更质押券后，可能存在多只质押券，初始交易的质押券也可能已经被全部换出，对于‘XYDQ’、‘XYXZ’、‘XYXB’、‘XYTG’、‘XYJZ’业务类别，**MXZQDM 字段仍填初始交易的证券代码**。

对于‘XYXB’业务存在三方，即正回购方、变更对手方前的原逆回购方（简称“原逆回购方”）、变更对手方后的新逆回购方（简称“新逆回购方”）；如无特别说明，以下的逆回购方及出资方在针对该业务时均指新逆回购方。对于‘XYXZ’业务，正回购方及逆回购方均按新协议成交金额以及原协议到期结算金额进行轧差之后清算交收。对于‘XYXB’业务，仅对正回购方按新协议成交金额以及原协议到期结算金额进行轧差之后清算交收，原逆回购方则会收到一笔原协议到期结算金额的应收款的 SJSMX0 数据，新逆回购方收到一笔新协议成交金额的应付款的 SJSMX0 数据。

SJSMX0.DBF 具体请参见下表：

字段名	业务类别		
	XYCS (协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购到期购回)	XYTG (协议回购提前购回)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYTG’
MXZQDM	初始交易证券代码	初始交易证券代码	初始交易证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号

字段名	业务类别		
	XYCS (协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购到期购回)	XYTG (协议回购提前购回)
MXYYB	营业部代码	营业部代码 逆回购方为空	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量 MXTGDY 为出资单元时>0; MXTGDY 为融资单元时<0;	0	0
MXQSSL	清算数量 MXTGDY 为出资单元时=0; MXTGDY 为融资单元时<0;	0	0
MXCJJG	百元资金利率	0	百元资金利率
MXQSJG	百元资金利率	0	百元资金利率
MXXYJY			
MXPCBS			
MXZQLB	初始交易证券类别	初始交易证券类别	初始交易证券类别
MXZQZL	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别
MXGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质
MXJSFS	‘R’	‘R’	‘R’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金	清算本金	清算本金
MXYHS			
MXJYJSF	交易经手费	交易经手费	交易经手费
MXJGGF			
MXGHF			
MXJSF	结算费	结算费	结算费
MXSXF			
MXQSYJ			
MXQTFY			
MXZJJE			
MXSFJE	收付净额	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日

字段名	业务类别		
	XYCS (协议回购初始交易)	XYDQ (协议回购到期购回)	XYTG (协议回购提前购回)
MXJSRQ	T 日	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日
MXQTRQ	拟购回日期		
MXSCDM			
MXJYFS	‘13’	‘13’	‘13’
MXZQDM2			
MXTGDY2			
MXDDBH2			
MXCWDH			
MXPPHM			
MXFJSM	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）
MXBYBZ			

注：MXJYFS 字段‘13’为新增的用于标识“固定收益交易平台”的交易方式。

字段名	业务类别		
	XYJZ (协议回购解除质押)	XYXZ (协议回购到期续做不变对手方)	XYXB (协议回购到期续做变更对手方)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账号	备付金账号
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘XYJZ’	‘XYXZ’	‘XYXB’
MXZQDM	初始交易证券代码	初始交易证券代码	初始交易证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码 原逆回购方为空
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	0	0	0
MXQSSL	0	0	0
MXCJG	0	百元资金利率	百元资金利率
MXQSJG	0	百元资金利率	百元资金利率

字段名	业务类别		
	XYJZ (协议回购解除质押)	XYXZ (协议回购到期续做 不变对手方)	XYXB (协议回购到期续做 变更对手方)
MXXYJY			
MXPCBS			
MXZQLB	初始交易证券类别	初始交易证券类别	初始交易证券类别
MXZQZL	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别
MXGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质
MXJSFS	‘N’	‘R’	‘R’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金	新协议成交金额 MXTGDY 为融资单元 时 ≥ 0 ; MXTGDY 为出资单元 时 ≤ 0 ;	正回购方及新逆回购 方填新协议成交金额 MXTGDY 为正回购方 时 ≥ 0 ; MXTGDY 为新逆回购 方时 ≤ 0 ; 原逆回购方填原协议 到期结算金额, ≥ 0 ;
MXYHS			
MXJYJSF	交易经手费	交易经手费	交易经手费
MXJGGF			
MXGHF			
MXJSF	结算费	结算费	结算费
MXSXF			
MXQSYJ			
MXQTFY			
MXZJJE		原协议到期结算金额 MXTGDY 为融资单元 时 ≤ 0 ; MXTGDY 为出资单元 时 ≥ 0 ;	正回购方填原协议到 期结算金额, ≤ 0 ; 新逆回购方及原逆回 购方填 0
MXSFJE	收付净额	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日
MXQTRQ		拟购回日期	拟购回日期 原逆回购方为空
MXSCDM			

字段名	业务类别		
	XYJZ (协议回购解除质押)	XYXZ (协议回购到期续做 不变对手方)	XYXB (协议回购到期续做 变更对手方)
MXJYFS	‘13’	‘13’	‘13’
MXZQDM2			
MXTGDY2			
MXDDBH2			
MXCWDH			
MXPPHM			
MXFJSM	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）
MXBYBZ			

1.3 交收明细结果库 SJSJG.DBF

SJSJG.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版）》。

对于 SJSJG.DBF 中‘XYCS’、‘XYDQ’、‘XYXZ’、‘XYXB’、‘XYTG’、‘XYJZ’业务，交收结果 T 日体现在 SJSJG.DBF 中。业务类别为‘XYHY’的数据表示参与人（包括融资方、出资方对应的参与人）下未购回的协议回购合约。对于‘XYHY’业务，JGZQDM 及 JGJSSL 不再填写。

对于‘XYCS’、‘XYBG’业务，SJSJG.DBF 中的 JGJSSL 并不表示股份的实际变更，‘XYCS’时只是在正回购方托管单元上做证券质押冻结，‘XYBG’只是在正回购方托管单元上做证券质押冻结、解冻，其中逆回购方记录不表示冻结、解冻仅供参考。对于‘XYDQ’、‘XYTG’、‘XYJZ’业务，JGYWLSH 不为空的记录表示交易指令交收结果，JGYWLSH 为空的记录为相应的解除质押明细，解除质押明细中的 JGJSSL 并不表示股份的实际变更，只是在正回购方原托管单元上解冻，其中逆回购方记录不表示解冻仅供参考。证券的冻结、解冻和变更也将体现在‘DJBG’中，购回时质押红利的解冻体现在 SJSJG.DBF 的‘DJJX’中。

字段名	业务类别		
	XYCS（初始交易）	XYDQ（到期购回）	XYTG（提前购回）
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘01’

JGYWLB	‘XYCS’	‘XYDQ’	‘XYTG’
JGZQDM	初始交易证券代码	初始交易证券代码	初始交易证券代码
JGJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
JGDDBH	订单编号	订单编号	订单编号
JGYYB	营业部代码	营业部代码 逆回购方为空	营业部代码
JGZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
JGCJSL	JGTGDY 为出资单元 时>0; JGTGDY 为融资单元 时<0;	0	0
JGQSSL	JGTGDY 为出资单元 时=0; JGTGDY 为融资单元 时<0;	0	0
JGJSSL	JGTGDY 为出资单元 时=0; JGTGDY 为融资单元 时<0; 检查失败的记录,该字 段填写 0	0	0
JGCJJG	百元资金年利率	0	百元资金年利率
JGQSJG	百元资金年利率	0	百元资金年利率
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	初始交易证券类别	初始交易证券类别	初始交易证券类别
JGZQZL	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别
JGGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质
JGLTLX	0	0	0
JGJSFS	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ	融资资金 JGTGDY 为出资单元 时<=0; JGTGDY 为融资单元 时>=0;	购回资金 JGTGDY 为出资单元 时>=0; JGTGDY 为融资单元 时<=0;	购回资金 JGTGDY 为出资单元 时>=0; JGTGDY 为融资单元 时<=0;
JGYHS			

JGJYJSF	经手费	经手费	经手费
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF	结算费	结算费	结算费
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE			
JGSFJE	收付净额	收付净额	收付净额
JGJSBZ	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’
JGZYDH	摘要代号	摘要代号	摘要代号
JGCJRQ	T 日	T 日	T 日
JGQSRQ	T 日	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ	拟购回日期		
JGSCDM			
JGJYFS	‘13’	‘13’	‘13’
JGZQDM2			
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）
JGBYBZ			

字段名	业务类别		
	XYJZ（解除质押）	XYXZ（到期续做不变对手方）	XYXB（到期续做变更对手方）
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘XYJZ’	‘XYXZ’	‘XYXB’
JGZQDM	初始交易证券代码	初始交易证券代码	初始交易证券代码
JGJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
JGDDBH	订单编号	订单编号	订单编号
JGYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码 对于原逆回购方为空
JGZXBH	执行编号	执行编号	执行编号

JGYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
JGCJSL	0	0	0
JGQSSL	0	0	0
JGJSSL	0	0	0
JGCJJG	0	百元资金年利率	百元资金年利率
JGQSJG	0	百元资金年利率	百元资金年利率
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	初始交易证券类别	初始交易证券类别	初始交易证券类别
JGZQZL	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别	初始交易证券子类别
JGGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质
JGLTLX	‘0’	‘0’	‘0’
JGJSFS	‘N’	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’
JGQSB	回购资金 JGTGDY 为出资单元 时 ≥ 0 ; JGTGDY 为融资单元 时 ≤ 0 ;	新协议成交金额 MXTGDY 为融资单元 时 ≥ 0 ; MXTGDY 为出资单元 时 ≤ 0 ;	正回购方及新逆回购 方填新协议成交金额: MXTGDY 为正回购方 时 ≥ 0 ; MXTGDY 为新逆回购 方时 ≤ 0 ; 原逆回购方填原协议 到期结算金额, ≥ 0 ;
JGYHS			
JGJYJSF	经手费	经手费	经手费
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF	结算费	结算费	结算费
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE		原协议到期结算金额 MXTGDY 为融资单元 时 ≤ 0 ; MXTGDY 为出资单元 时 ≥ 0 ;	正回购方填原协议到 期结算金额, ≤ 0 ; 新逆回购方及原逆回 购方填 0
JGSFJE	收付净额	收付净额	收付净额
JGJSBZ	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’
JGZYDH	摘要代号	摘要代号	摘要代号
JGCJRQ	T 日	T 日	T 日

JGQSRQ	T 日	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ		拟购回日期	拟购回日期 原逆回购方为空
JGSCDM			
JGJYFS	‘13’	‘13’	‘13’
JGZQDM2			
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM	初始交易编号（左对齐右补空格）	初始交易编号（左对齐，右补空格）	初始交易编号（左对齐右补空格）
JGBYBZ			

字段名	业务类别		
	XYHY（协议回购合约）	XYBG（变更质押券）	XYDQ/XYTG/XYJZ （到期购回/提前购回/解除质押）解除质押 明细
JGJSZH	结算账户	结算账号	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘02’	‘01’	‘02’
JGYWLB	‘XYHY’	‘XYBG’	‘XYDQ’/‘XYTG’/‘XYJZ’
JGZQDM		证券代码 换出资金记录填空	证券代码
JGJYDY			
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
JGDDBH		订单编号	
JGYIB			
JGZXBH		执行编号	
JGYWLSH			
JGCJSL		正回购方填写 <0，委托换入数量 =0，换出资金 >0，委托换出数量 逆回购方填写 >0，委托换入数量 =0，换出资金	0

		<0, 委托换出数量	
JGQSSL			
JGJSSL		正回购方填写 <0, 换入证券数量 =0, 为不确认记录或换出资金记录 >0, 换出证券数量 逆回购方填写 >0, 换入证券数量 =0, 为不确认记录或换出资金记录 <0, 换出证券数量	解除质押数量 >0 协议回购正回购方 <0 协议回购逆回购方
JGCJJG	百元资金年利率		
JGQSJG			
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB		证券类别	证券类别
JGZQZL		证券子类别	证券子类
JGGFXZ		股份性质	股份性质
JGLTLX		'0'	'0'
JGJSFS		'N'	
JGHBDDH		若有资金, 为 'RMB'	若有资金, 为 'RMB'
JGQSBJ	初始交易金额(对于到期续做后的合约为新协议成交金额) <0 协议回购融资方 >0 协议回购出资方	若有资金, 为委托换出资金金额 为正回购方时>0 为逆回购方时<0	
JGYHS			
JGJYJSF			
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF			
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE		若有资金, 为换出的资金金额 为正回购方时>0 为逆回购方时<0	若有资金, 为解押资金金额 为正回购方时>=0; 为逆回购方时<=0;

JGSFJE		收付净额	
JGJSBZ	‘N’	‘Y’或‘N’	‘Y’
JGZYDH		摘要代号	
JGCJRQ	初始成交日期(对于到期续做后的合约为续做成交日期)	T 日	
JGQSRQ		T 日	
JGJSRQ		T 日	
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ	拟购回日期		
JGSCDM			
JGJYFS		‘13’	
JGZQDM2			
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM	初始交易编号 (左对齐右补空格)	初始交易编号 (左对齐右补空格)	初始交易编号 (左对齐右补空格)
JGBYBZ			

1.4 综合数据服务库 SJSFW.DBF

协议回购的质押明细数据通过数据类别‘11’和‘13’分别向正回购方和逆回购方发送。其中数据类别‘13’含义调整为“三方回购及协议回购逆回购方质押明细”。

SJSFW.DBF 具体结构请见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版）》。

字段名	数据类别
	13 (三方回购及协议回购逆回购方 质押明细)
FWSJLB	13
FWJSZH	结算账户
FWBFZH	
FWTGDY	托管单元
FWZQDM	证券代码
FWZQZH	证券账户
FWGFXZ	股份性质
FWLTLX	流通类型
FWMRJE	冻结本金
FWMCJE	冻结红利
FWZJYE	冻结数量

字段名	数据类别
	13 (三方回购及协议回购逆回购方 质押明细)
FWSL1	
FWSL2	
FWCLRQ	
FWFSRQ	
FWZYSM	1-2 位冻结类型填 SY 表示为三方 回购质押冻结, 填 XY 表示为协 议回购质押冻结 5-20 位业务流水号填空 23-46 位冻结序号填三方回购合 约编号或协议回购初始交易编号 49 位表示是否为可售冻结 (N: 不可售冻结; Y: 可售冻结) 52-75 位: 若本笔冻结存在司法再 冻结, 则填写司法再冻序号, 其 余为空 77-84 位: 冻结截止日期, 格式为 CCYYMMDD, 若为 00010101 表 示无限期冻结
FWBZSM	若本笔冻结存在司法再冻结, 则 填写执行机关名称
FWBYBZ	

1.5 资金清算汇总库 SJSQS.DBF

对于 SJSQS.DBF 中的‘XYXZ’(协议回购到期续做不变对手方)业务及‘XYXB’
(协议回购到期续做变更对手方)业务, QSMRJE+QSMCJE 为到期续做轧差资金
(购回资金+续做资金)

SJSQS.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范(结算参
与人版)》。

业务类别	相应业务含义	说明
XYCS	债券质押式协议回购初始 交易	QSZQDM 为协议回购初始交易 证券代码; 成交日期=清算日期, 交收日期 =清算日期; QSMRJE+QSMCJE 为融资或出

		资资金，QSJYJSF 为交易经手费，QSJSF 为结算费。
XYDQ	债券质押式协议回购到期购回	QSZQDM 为协议回购初始交易证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为购回资金。
XYTG	债券质押式协议回购提前购回	QSZQDM 为协议回购初始交易证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为购回资金。
XYJZ	债券质押式协议回购解除质押	QSZQDM 为协议回购初始交易证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为购回资金。
XYXZ	债券质押式协议回购到期续做不变对手方	QSZQDM 为协议回购初始交易证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为到期续做轧差资金（购回资金+续做资金），QSJYJXY 为交易经手费，QSJXY 为结算费。
XYXB	债券质押式协议回购到期续做变更对手方	QSZQDM 为协议回购初始交易证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为到期续做轧差资金（购回资金+续做资金），QSJYJXY 为交易经手费，QSJXY 为结算费。

1.6 广播类信息库 SJSGB.DBF

新增的‘DJBG’的变更代号通过 SJSGB 中广播类别为‘ZY’的数据发送。调整后，协议回购业务涉及的变更代号如下：

变更代号	变更代号名称
N25	协议回购初始质押
N26	协议回购到期购回解除质押
M44	协议回购提前购回解除质押
M45	协议回购解除质押指令解除质押
M46	协议回购变更质押券

二、 联系方式

技术咨询：0755-25946080

业务咨询：0755-21899255