

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

债券借贷业务之
券商技术系统变更指南
(Ver1.00)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇二一年七月

关于本文档

文档名称	深圳证券交易所债券借贷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
2021-07-22	1.00	创建文档	技术开发版

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 标的证券与质押证券的数量申报方式	3
3.3 收盘行情文件	4
四、 成交申报	5
4.1 Binary 接口委托申报	5
4.2 STEP 接口委托申报	45
五、 转发成交申报	87
5.1 Binary 接口转发成交申报	87
5.2 STEP 接口转发成交申报	93
六、 成交申报响应	100
6.1 Binary 接口成交申报响应	100
6.2 STEP 接口成交申报响应	105
七、 成交确认	108
7.1 Binary 接口成交确认	108
7.2 STEP 接口成交确认	112
八、 清算和交收	115
九、 开展债券借贷业务的券商系统注意事项	116
9.1 行情相关说明	116
9.2 委托回报相关说明	116
9.3 关于客户委托服务渠道	116
9.4 关于券商柜台系统	116
十、 联系方式	117
附件一、 债券借贷业务的结算数据接口修订说明	117
一、 结算数据接口修订	117
1.1 接口修订简要说明	117
1.2 清算明细库 SJSMX0.DBF	118
1.3 交收明细结果库 SJSJG.DBF	122
1.4 综合数据服务库 SJSFW.DBF	127

1.5 资金清算汇总库 SJSQS.DBF	129
1.6 广播类信息库 SJSGB.DBF	130
二、 联系方式	130

深圳证券交易所

债券借贷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借贷业务，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

债券借贷业务是指债券融入方（以下简称“借入方”）提供一定数量的履约保障品，从债券融出方（以下简称“借出方”）借入标的债券，同时约定在未来某一日期归还所借入标的债券，并由债券融出方返还履约保障品的债券融通行为。

2.1 交易流程

- (1) 借入方按照规定格式提交初始交易委托，委托中包含标的证券代码、标的证券数量、借贷期限、借贷费率、申报宽限期、质押券证券代码、股份性质和数量以及指定的借出方交易商、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借出方；
- (3) 借出方对交易系统转发的初始交易委托中的标的证券代码、标的证券数量、借贷期限、借贷费率、申报宽限期、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) 交易系统对借出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借入方，以通知借入方申报的初始交易委托被借出方拒绝。
- (5) 交易系统对于借出方申报的接受成交申报委托与借入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并对标的券过户；
- (6) 到期结算日之前（不含到期结算日，以下简称“借贷存续期”），借入方可以按照约定格式提交质押券变更委托，经借出方确认后，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) 借贷存续期间，借入方或借出方可以按照规定格式提交提前终止委托，委托中包含提前终止的借贷费用金额，经响应方确认后，可以提前了结合约；
- (8) 到期结算日和申报宽限日（即到期结算日至到期结算日后的第 N 个交易日（含），N 为初始交易、到期续做时指定的申报宽限期，若 T 日为到期结算日，申报宽限期为 1 天，则 T+1 日为申报宽限日，下同），借入方可按照规定格式提交到期结算委托了结合约；
- (9) 到期结算日和申报宽限日，借入方可按照规定格式提交到期续做委托，经借出方确认后，可实现合约续做；允许到期续做时变更质押券，也可以不变更质押券，到期续做时不允许变更对手方和标的证券代码，但允许变更标的证券的数量；
- (10) 若未能在到期结算日和申报宽限日及时了结或续做合约，在申报宽限日之后，借入方可按照规定格式提交解除质押委托了结合约，解除质押委托需借出方确认；
- (11) 深交所交易系统对初始交易委托、质押券变更委托、到期结算委托、到期续做委托、提前终止委托、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债券借贷提供相应的证券质押冻结和清算交收等服务。
- (13) 发起方提交的初始交易委托、质押券变更委托、到期结算委托、到期续做委托、提前终止委托、解除质押委托成交请求均允许主动撤单，但在响应方提交匹配的响应申报后，发起方不得再撤销请求委托。主动撤单申请与拟撤销的成交请求委托必须在同一个交易单元申报。

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者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

债券借贷的各委托类型, 即初始交易、到期结算、到期续做、提前终止、质押券变更、解除质押, 均使用成交请求模式, 并且适用债券交易账户体系。

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》“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》“成交请求申报模式 (one party report for pass through)”一节。

债券交易账户体系在成交请求模式中的实施细节请参考《债券质押式协议回购业务之券商技术系统变更指南》“支持债券交易账户体系”一节。

3.2 标的证券与质押证券的数量申报方式

债券借贷业务引入券面总额字段以申报标的券、质押券的数量。

对于基础设施基金, 仍使用委托中的数量 (LastQty/DeliveryQty) 字段, 对标的券、质押券进行数量申报; 对于除基础设施基金外的证券, 应使用券面总额 (CashOrderQty/UnderlyingCashOrderQty) 字段对标的券、质押券进行数量申报, 在债券借贷业务中, 券面总额的含义为数量*对应债券的实际面值。

具体申报及回报规则如下:

申报初始交易、到期续做、到期结算、提前终止时, 若标的证券为基础设施基金时, 交易双方应通过委托的数量 (LastQty) 字段填报借入\归还的标的券数量, 单位为份, 深交所以该字段做为股份数量检查的依据, 并且通过“数量*昨收价”计算得到标的证券券面总额, 填入回报中的标的证券券面总额 (CashOrderQty) 字

段，作为借贷费用计算的依据。若标的证券为债券、资产支持证券时，交易双方应通过委托的标的证券券面总额（CashOrderQty）字段填入借入\归还的标的证券券面总额，单位为元，深交所通过“标的证券券面总额/标的证券实际面值”计算得到标的证券数量（除不尽时截断小数部分），填入回报中的数量（LastQty）字段，并以计算得到的标的证券数量做为股份检查的依据，原委托提交的券面总额（CashOrderQty）将作为借贷费用计算的依据。

申报初始交易、到期续做、质押券变更时，若质押\解押证券为基础设施基金，交易双方应通过委托的质押\解押证券的数量（DeliveryQty）字段填报质押\解押的证券数量，单位为份，深交所该字段做为股份数量检查的依据。若质押\解押证券为债券、资产支持证券时，交易双方应通过委托的质押券券面总额（UnderlyingCashOrderQty）字段填报质押\解押的券面总额，深交所通过“质押券券面总额/质押券实际面值”计算质押\解押证券数量（除不尽时截断小数部分），填入回报中的质押\解押证券的数量（DeliveryQty）字段，并以计算得到的质押证券数量做为股份检查的依据。

标的证券和质押券的昨收价以委托申报所在交易日的交易参考信息“证券信息（securities）”中的昨日收盘价（PrevClosePx）字段为准。实际面值以委托申报所在交易日的交易参考信息“证券信息（securities）”中的面值（ParValue）字段为准。

交易参考信息“证券信息（securities）”内容详见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》。

3.3 收盘行情文件

债券借贷业务每个交易日收盘后发送债券借贷收盘行情文件，具体内容参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范.docx》中“债券借贷收盘行情（bondlendingclosemd）”章节。

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	借入方成交请求 字段取值	借入方主动撤单 委托字段取值	借出方点击成交 申报（同意成交） 字段取值	借出方点击成 交申报（拒绝成交） 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交 申报
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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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, 借出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	借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	借出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	如果标的证券为基础设施基金, 填标的证券数量, 单位	填 0.00	如果标的证券为基础设施基金, 填标的证券数量, 单位	如果标的证券为基础设施基金, 填标的证券数量, 单位

		为份，必须大于 0 且为万份的整数倍；其他情况填 0.00。		为份，必须大于 0 且为万份的整数倍；其他情况填 0.00。	为份，必须大于 0 且为万份的整数倍；其他情况填 0.00。
TrdType	成交申报业务类别	1061=初始交易	1061=初始交易	1061=初始交易	1061=初始交易
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	对方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	全空格	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。
Side	本方参与者买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方
PBUID	本方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
AccountID	本方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型

	03=机构经纪				
InvestorID	本方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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 本方客户名称	借入方客户名称	借入方客户名称	借出方客户名称	全空格
TraderCode	本方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
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	期限	0	期限	期限
CashOrderQty	标的证券券面总额	如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券	填 0.0000	如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券	如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券

		面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万元的整数倍; 其他填 0.0000。		面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万元的整数倍; 其他填 0.0000。	面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万元的整数倍; 其他填 0.0000。
SubstCash	现金结算金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
GracePeriod	申报宽限期	申报宽限期	填 0	申报宽限期	申报宽限期
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
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
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	固定填 102	无此字段	固定填 102
→	DeliveryQty	数量	如果质押证券为基础设施基金, 填质押证券数量, 单位为份, 必须大于 0	无此字段	如果质押证券为基础设施基金, 填质押证券数量, 单位为份, 必须大于 0

			且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。		且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
→	DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	1	无此字段	1	1
→	UnderlyingShareProperty	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
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍；其他填 0.0000。	无此字段	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍；其他填 0.0000。	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍；其他填 0.0000。

表 4-2 到期续做委托消息定义

域名	字段描述	借入方成交请求字段取值	借入方主动撤单委托字段取值	借出方点击成交申报(同意成交)字段取值	借出方点击成交申报(拒绝成交)字段取值
Standard Header	消息头				

	MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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,借 出方填写转发成交申 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	填借出方接收的转 发成交申报的客户 成交申报编号	填借出方接收的转 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	如果标的证券为基 础设施基金, 填续	填 0.00	如果标的证券为基 础设施基金, 填续	如果标的证券为基 础设施基金, 填续

		做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。		做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
TrdType	成交申报业务类别	1063=到期续做	1063=到期续做	1063=到期续做	1063=到期续做
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留，固定填 0	0	0	0	0
ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	全空格	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。
Side	本方参与人买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方
PBUID	本方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
AccountID	本方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码

		码	代码	码	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	借出方交易员代码	借出方交易员代 码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
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	续做期限	填 0	续做期限	续做期限
CashOrderQty	标的证券券面总额	如果标的证券为债 券或者资产支持证 券, 填标的证券券 面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万 元的整数倍。其他 填 0.0000。	填 0.0000	如果标的证券为债 券或者资产支持证 券, 填标的证券券 面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万 元的整数倍。其他 填 0.0000。	如果标的证券为债 券或者资产支持证 券, 填标的证券券 面总额, 单位为元, 必须大于 0 且为万 元的整数倍。其他 填 0.0000。
SubstCash	现金结算金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000

		额				
AccruedInterestAmt		借贷费用金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SettlCurrAmt		借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额	填 0.0000	借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额
GracePeriod		申报宽限期	申报宽限期	填 0	申报宽限期	申报宽限期
SupplementaryAgreementLen		补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement		补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
NoSecurity		质押券个数	质押券个数	质押券个数	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	如果质押、解押证券为基础设施基金，填质押、解押的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	无此字段	如果质押、解押证券为基础设施基金，填质押、解押的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	如果质押、解押证券为基础设施基金，填质押、解押的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。

→	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
→	UnderlyingShareProperty	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
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	无此字段	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。

表 4-3 提前终止委托消息定义

域名	字段描述	发起方成交 请求字段取值	发起方主动 撤单委托字段 取值	响应方点击成 交申报(同意成交) 字段取值	响应方点击成 交申报(拒绝成交) 字段取值
Standard Header	消息头				

	MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成 交申报	420=债券借贷 成交申报	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交 申报
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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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, 借出方填写转发成交 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	填响应方接收的转 发成交申报的客户 成交申报编号	填响应方接收的转 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	若标的证券已摘 牌, 必须填 0; 若标的证券为基 础设施基金, 填 归还的标的证券 数量, 单位为份, 必须为万份的整	填 0.00	若标的证券已摘 牌, 必须填 0; 若 标的证券为基础 设施基金, 填归还 的标的证券数量, 单 位为份, 必须为万 份的整数倍; 其他	若标的证券已摘 牌, 必须填 0; 若 标的证券为基础 设施基金, 填归还 的标的证券数量, 单 位为份, 必须为万 份的整数倍; 其他

		数倍；其他情况 填 0.00		情况填 0.00	情况填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1064=提前终止	1064=提前终止	1064=提前终止	1064=提前终止
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	对方交易主体类型 为“机构经纪” 时，填约定号， 必须不为空；其 他填空格。	全空格	本方交易主体类型 为“机构经纪”时， 填约定号，必须不 为空；其他填空格。	本方交易主体类型 为“机构经纪”时， 填约定号，必须不 为空；其他填空格。
Side	本方与人买卖方向 2=借入方 1=借出方	发起方的方向： 1、2	发起方的方向： 1、2	响应方的方向：2、 1	响应方的方向：2、 1
PBUID	本方交易单元	发起方交易单元	发起方交易单 元	响应方交易单元	响应方交易单元
AccountID	本方证券账户	发起方证券账户	发起方证券账 户	响应方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	发起方营业部代 码	发起方营业部 代码	响应方营业部代码	响应方营业部代码
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	发起方交易商代码	发起方交易商代码	响应方交易商代码	响应方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	发起方交易主体类型	发起方交易主体类型	响应方交易主体类型	响应方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	发起方交易主体代码	发起方交易主体代码	响应方交易主体代码	响应方交易主体代码
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	发起方交易员代码	发起方交易员代码	响应方交易员代码	响应方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	响应方交易商代码	响应方交易商代码	发起方交易商代码	发起方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	响应方交易主体类型	响应方交易主体类型	发起方交易主体类型	发起方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	响应方交易主体代码	响应方交易主体代码	发起方交易主体代码	发起方交易主体代码
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	响应方交易员代码	响应方交易员代码	发起方交易员代码	发起方交易员代码

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	标的证券券面总额	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	填 0.0000	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。
SubstCash	现金结算金额	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算。	填 0.0000	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算。	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算。
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	通过场内支付的现金结算金额	填 0.0000	通过场内支付的现金结算金额	通过场内支付的现金结算金额

AccruedInterestAmt	借贷费用金额	提前终止的借贷费用	填 0.0000	提前终止的借贷费用	提前终止的借贷费用
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	提前终止的借贷费用场内支付金额	填 0.0000	提前终止的借贷费用场内支付金额	提前终止的借贷费用场内支付金额
GracePeriod	申报宽限期	填 0	填 0	填 0	填 0
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
NoSecurity	质押券个数	填 0	填 0	填 0	填 0

表 4-4 质押券变更委托消息定义

域名	字段描述	借入方成交请求 字段取值	借入方主动 撤单委托字段 取值	借出方点击 成交申报（同 意成交）字段 取值	借出方点 击成交申报 （拒绝成交） 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷 成交申报	420=债券借贷 成交申报	420=债券借贷 成交申报

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	3	3	3	3

	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				
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, 借出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	填借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填借出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	1066=质押券变更	1066=质押券变更	1066=质押券变更	1066=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	对方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	全空格	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。
Side	本方参与人买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方
PBUID	本方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元

			元	元	元
AccountID	本方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方申报方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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	借入方交易员代码	借入方交易员 代码	借出方交易员 代码	借出方交易员 代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商 代码	借入方交易商 代码	借入方交易商 代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借出方交易主体类 型	借出方交易主 体类型	借入方交易主 体类型	借入方交易主 体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	借出方交易主体代 码	借出方交易主 体代码	借入方交易主 体代码	借入方交易主 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	借出方交易员代码	借出方交易员 代码	借入方交易员 代码	借入方交易员 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	对应初始交易

				的交易编号	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	标的证券券面总额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SubstCash	现金结算金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	换出金额	填 0.0000	换出金额	换出金额
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
GracePeriod	申报宽限期	填 0	填 0	填 0	填 0
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
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
→	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	固定填 102	无此字段	固定填 102
→	DeliveryQty	数量	如果质押证券、解押证券为基础设施基金, 填质押证券、解押证券数量, 单	无此字段	如果质押证券、解押证券为基础设施基金, 填质押证

			位为份,必须大于0且为万份的整数倍,其他情况填0.00。		券、解押证券数量,单位为份,必须大于0且为万份的整数倍,其他情况填0.00。	券、解押证券数量,单位为份,必须大于0且为万份的整数倍,其他情况填0.00。
→	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
→	UnderlyingShareProperty	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
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券,填质押证券券面总额,单位为元;换入时必须大于0且为万元的整数倍;换出时必须大于0且为一元的整数倍;其他	无此字段	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券,填质押证券券面总额,单位为元;换入时必须大于0且为万元的整数倍;换	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券,填质押证券券面总额,单位为元;换入时必须大于0且为万元的整数倍;换

			情况填 0.0000。		出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。
--	--	--	-------------	--	---------------------------------	---------------------------------

表 4-5 解除质押委托消息定义

域名	字段描述	借入方成交请求 字段取值	借入方主动 撤单委托字段 取值	借出方点击 成交申报（同 意成交）字段 取值	借出方点 击成交申报 （拒绝成交） 字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷 成交申报	420=债券借贷 成交申报	420=债券借贷 成交申报
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	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

	104=自营交易发起				
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, 借出方填写转发成交申报的	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	填借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号

	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	1065=解除质押	1065=解除质 押	1065=解除质 押	1065=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	对方交易主体类型 为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不 为空; 其他填空格。	全空格	本方交易主体 类型为“机构 经纪”时, 填 约定号, 必须 不为空; 其他 填空格。	本方交易主体 类型为“机构 经纪”时, 填 约定号, 必须 不为空; 其他 填空格。
Side	本方参与人买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方
PBUID	本方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单 元	借出方交易单 元	借出方交易单 元
AccountID	本方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账 户	借出方证券账 户	全空格
BranchID	本方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部 代码	借出方申报方 营业部代码	借出方营业部 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	借入方交易商代码	借入方交易商 代码	借出方交易商 代码	借出方交易商 代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借入方交易主体类 型	借入方交易主 体类型	借出方交易主 体类型	借出方交易主 体类型
InvestorID	本方交易主体代码	借入方交易主体代 码	借入方交易主 体代码	借出方交易主 体代码	借出方交易主 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	借入方交易员代码	借入方交易员 代码	借出方交易员 代码	借出方交易员 代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商 代码	借入方交易商 代码	借入方交易商 代码

CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
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	标的证券券面总额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SubstCash	现金结算金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	解除质押金额	填 0.0000	解除质押金额	解除质押金额

AccruedInterestAmt	借贷费用金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
GracePeriod	申报宽限期	填 0	填 0	填 0	填 0
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
NoSecurity	质押券个数	填 0	填 0	填 0	填 0

表 4-6 到期结算消息定义

域名	字段描述	借入方成交请求 字段取值	借入方主动撤单 委托字段取值	借出方点击成交 申报（同意成交）字 段取值	借出方点击成交 申报（拒绝成交）字 段取值
Standard Header	消息头 MsgType=104203				
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申 报	420=债券借贷成交申 报	420=债券借贷成交申 报	420=债券借贷成交申 报
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	归还标的证券代码	全空格	归还标的证券代码	归还标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
OwnerType	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	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				
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	全空格	被撤委托的客户成交申报编号	借出方接收的转发成交申报的客户成交申	借出方接收的转发成交申报的客户成交申

	对于成交请求模式，借出方填写转发成交申报的客户成交申报编号			报编号	报编号
LastPx	价格	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
LastQty	数量	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为基础设施基金，填归还标的证券数量，单位为份，必须为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	填 0.00	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为基础设施基金，填归还标的证券数量，单位为份，必须为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为基础设施基金，填归还标的证券数量，单位为份，必须为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
TrdType	成交申报业务类别	1062=到期结算	1062=到期结算	1062=到期结算	1062=到期结算
TrdSubType	成交申报业务子类 预留，固定填 0	0	0	0	0
ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	全空格	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。
Side	本方参与人买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方
PBUID	本方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元	借入方交易单元
AccountID	本方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账户	借入方证券账户	全空格
BranchID	本方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借入方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
InvestorType	本方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
InvestorID	本方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型 01=自营 02=资管 03=机构经纪	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
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	0	0	0	0

CashOrderQty	标的证券券面总额	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他填 0.0000。	0.0000	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他填 0.0000。	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他填 0.0000。
SubstCash	现金结算金额	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，必须为一元的整数倍。	0.0000	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，必须为一元的整数倍。	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，必须为一元的整数倍。
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	通过场内支付的现金结算金额，必须为一元的整数倍。	0.0000	通过场内支付的现金结算金额，必须为一元的整数倍。	通过场内支付的现金结算金额，必须为一元的整数倍。
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额	0.0000	借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额
GracePeriod	申报宽限期	填 0	填 0	填 0	填 0
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度	补充约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定

NoSecurity	质押券个数	0	0	0	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) 对于初始交易和到期续做，LastPx（价格）应大于 0，其含义为年化利率（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%。
- (3) 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）字段并发送给借入方、借出方，到期结算、提前终止、解除质押、到期续做、质押券变更申报时应填写对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。
- (4) 对于初始交易、到期续做，ExpirationDays（借贷期限）应当为[1,365]区间内的任意整数，且不得超过标的证券券和质押证券的存续期间；标的证券券和质押证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，特定债、基础设施基金无此要求。对于到期结算、质押券变更、提前终止、解除质押，ExpirationDays（借贷期限）应当填 0。
- (5) 申报初始交易、到期续做时，需填写 GracePeriod（申报宽限期）字段，目前应固定填 1。
- (6) SupplementaryAgreement（补充约定）字段可由交易双方自行约定填写与本次交易相关的内容，不超过 600 字节。SupplementaryAgreementLen（补充约定长度）填写补充约定的字节数量。
- (7) 到期续做、提前终止、质押券变更、解除质押、到期结算的借入方、借出方的交易单元、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。
- (8) 借入方、借出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	到期结算	到期续做	提前终止	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	√	×	√	×	×	×
标的证券代码 (SecurityID)	一致	√	√	√	√	×	×
标的证券代码源 (SecurityIDSource)	一致	√	√	√	√	×	×
标的证券数量 (LastQty) 或 标的证券券面 总额 (CashOrderQty)	一致	√	√	√	√	×	×
成交申报业务 类别 (TrdType)	一致	√	√	√	√	√	√
买卖方向(Side)	借入、借出方向相反	√	√	√	√	√	√
约定号 (ConfirmID)	当发起方的对方交易主体类型为“机构经纪”时， 检查一致性	√	√	√	√	√	√
交易编号 (TrdMatchId)	一致	×	√	√	√	√	√
期限 (ExpirationDays)	一致	√	×	√	×	×	×
现金结算金额 (SubstCash)	一致	×	√	×	√	×	×
现金结算场内	一致	×	√	×	√	√	√

支付金额 (AllocSettlCurr Amt)							
借贷费用金额 (AccruedInter estAmt)	一致	×	×	×	√	×	×
借贷费用场内 支付金额 (SettlCurrAmt)	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）或质押券券面总额（UnderlyingCashOrderQty）、方向（DeliverySide）、股份性质（UnderlyingShareProperty）。

(9) NoSecurity（质押券个数）字段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，DeliverySide为“质押”的记录最多只能有30条，不能存在DeliverySide为“解押”的记录；对于质押券变更、到期续做，DeliverySide为“质押”的记录最多只能有30条，DeliverySide为“解押”的记录最多只能有30条。

(10) 到期结算和到期续做只能在到期结算日和申报宽限日申报，若到期结算日为非交易日，则只能在到期结算日后一交易日及下个交易日申报。提前终止、质押券变更只能在到期结算日之前（不含到期结算日、不含初始交易成交日）申报。解除质押只能在申报宽限日之后（不含申报宽限日）申报。举例说明，某合约到期结算日为20180512日（周六），则在20180512日之前可以申报提前终止、质押券变更委托，在20180514日（到期结算日）和20180515（申报宽限日）可申报到期结算和到期续做委托，下20180515日之后的交易日（不包含20180515日）可申报解除质押委托。

(11) 对于未到期合约，如果发起方已提交了合法的提前终止委托，则发起方不能继续申报质押券变更委托或者再次提交提前终止委托。如果响应方拒绝了该笔提前终止委托或发起方对该笔提前终止委托主动撤单成功，则借入

- 方可以继续申报质押券变更委托，交易双方可再次提交提前终止委托。
- (12) 对于当日到期或宽限期的合约，如果借入方提交的到期结算委托已成交确认，则借入方不能继续申报到期续做委托或者再次提交到期结算委托。如果借出方拒绝了该笔到期结算委托或借入方对该笔到期结算委托主动撤单成功，则借入方可以继续申报到期结算委托以及再次提交到期续做委托。
- (13) 对于当日到期或宽限期的合约，如果借入方已提交了合法的到期续做委托，则借入方不能继续提交到期结算委托或者再次提交到期续做委托。如果借出方拒绝了该笔到期续做委托或借入方对该笔到期续做委托主动撤单成功，则借入方可以继续申报到期结算委托以及再次提交到期续做委托。
- (14) 对于已逾期的合约，如果借入方已提交了合法的解除质押委托，则借入方不能再次提交解除质押委托。如果借出方拒绝了该笔解除质押委托或借入方对该笔解除质押委托主动撤单成功，则借入方可以再次提交解除质押委托。
- (15) 对于支持使用首发后限售股份进行债券借贷质押的质押券，重复组中对应的股份性质（UnderlyingShareProperty）字段可填写为 00 或 01，否则股份性质（UnderlyingShareProperty）字段固定为 00。
- (16) 申报到期续做、提前终止、到期结算委托时，现金结算金额、现金结算场内支付金额、借贷费用金额、借贷费用场内支付金额大于 0 时，必须为 0.01 的整数倍。
- (17) 申报初始交易委托时，质押券个数字段必须大于 0；申报质押券变更、到期续做委托时，委托中的质押券信息用于增量维护原合约的质押券信息，质押券个数字段必须大于等于 0；申报到期结算、提前终止、解除质押委托时，质押券个数字段必须为 0。

4.2 STEP 接口委托申报

表 4-7 初始交易委托消息定义

Tag	域名	字段描述	借入方成交请求字段取值	借入方主动撤单委托字段取值	借出方点击成交申报（同意成交）字段取值	借出方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
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	1061=初始交易	1061=初始交易	1061=初始交易	1061=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, 成交报告 2=One-Party Report For	3	3	3	3

		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, 借 出方填写转发成交申 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	填借出方接收的转发成 交申报的客户成交申报 编号	填借出方接收的转发成 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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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	1	
→	54	Side	买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
	→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
		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	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	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	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	
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	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	
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	当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	当借出方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填 2; 否则填 1	1	
→	523	PartySubID	参与方子代码	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	借出方客户名称 当借出方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写逆方客户名称; 否则不需要填写	不需要填写
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	借出方客户名称 当借出方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	不需要填写

		组件结束					
448	PartyID	参与人代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码	
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	
448	PartyID	参与人代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码	
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	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	
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	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
	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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码	
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	如果标的证券为基础设施基金，填标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	填 0.00	如果标的证券为基础设施基金，填标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	如果标的证券为基础设施基金，填标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
152	CashOrderQty	标的证券券面总额	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。	不需要填写	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。
664	ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填充格。	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填充格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填充格。
8911	ExpirationDays	期限，单位为天数	期限	不需要填写	期限	期限
737	AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写

8904	SubstCash		现金结算金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
159	AccruedInterestAmt		借贷费用金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
119	SettlCurrAmt		借贷费用场内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10244	GracePeriod		申报宽限期	申报宽限期	不需要填写	申报宽限期	申报宽限期
10245	SupplementaryAgreement		补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
组件<CompDeliverSecurity>							
8902	NoSecurity		质押券个数	质押券个数	不需要填写	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	如果质押证券为基础设施基金，填质押证券数量，单位为份，必须大于0且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	不需要填写	如果质押证券为基础设施基金，填质押证券数量，单位为份，必须大于0且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	如果质押证券为基础设施基金，填质押证券数量，单位为份，必须大于0且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
→	10195	DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	1	不需要填写	1	1

→	10206	UnderlyingShareProperty	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
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于0且为万元的整数倍；其他填0.0000。	不需要填写	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于0且为万元的整数倍；其他填0.0000。	如果质押证券为债券或者资产支持证券，填质押券券面总额，单位为元，必须大于0且为万元的整数倍；其他填0.0000。
组件结束							

表 4-8 到期续做委托消息定义

Tag	域名	字段描述	借入方成交请求 字段取值	借入方主动撤单委托 字段取值	借出方点击成交申报（同 意成交）字段取值	借出方点击成交申报 （拒绝成交）字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
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	1063=到期续做	1063=到期续做	1063=到期续做	1063=到期续做
829	TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	0	0	0	0
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, 借出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	填借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填借出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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource		证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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=借入方	2=借入方	1=借出方	2=借出方

组件<Parties>							
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
	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	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	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	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
	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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码
	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	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
	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	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写正方客户名称; 否则不需要填写	借出方客户名称 当借出方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写逆方客户名称; 否则不需要填写	不需要填写
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	借出方客户名称 当借出方交易主体类型为 03=机构经纪时, 填写“5=本方客户名称”; 否则不需要填写	不需要填写
	组件结束						
448	PartyID	参与人代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码	
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	
448	PartyID	参与人代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码	
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	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
	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	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型
		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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
	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]	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

			且必须为 0.01 的整数倍			
32	LastQty	数量	如果标的证券为基础设施基金，填续做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	填 0.00	如果标的证券为基础设施基金，填续做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。	如果标的证券为基础设施基金，填续做的标的证券数量，单位为份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
152	CashOrderQty	标的证券券面总额	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。	不需要填写	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。	如果标的证券为债券或者资产支持证券，填标的证券券面总额，单位为元，必须大于 0 且为万元的整数倍。其他不需要填写。
664	ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时，填约定号，必须不为空；其他填空格。
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	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

737	AllocSettlCurrAmt		现金结算场内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8904	SubstCash		现金结算金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
159	AccruedInterestAmt		借贷费用金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
119	SettlCurrAmt		借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额, 若为 0 则不需要填写	不需要填写	借贷费用场内支付金额, 若为 0 则不需要填写	借贷费用场内支付金额, 若为 0 则不需要填写
10244	GracePeriod		申报宽限期	申报宽限期	不需要填写	申报宽限期	申报宽限期
10245	SupplementaryAgreement		补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
组件<CompDeliverSecurity>							
8902	NoSecurity		质押券个数	质押券个数	不需要填写	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	UnderlyingSecurityIDSour ce	固定填 102	102	不需要填写	102	102
→	8903	DeliveryQty	数量	如果质押、解押证券为基础设施基金, 填质押、解押的证券数量, 单位为份, 必须大于 0 且为万份的整数倍, 其他情况填 0.00。	不需要填写	如果质押、解押证券为基础设施基金, 填质押、解押的证券数量, 单位为份, 必须大于 0 且为万份的整数倍, 其他情况填 0.00。	如果质押、解押证券为基础设施基金, 填质押、解押的证券数量, 单位为份, 必须大于 0 且为万份的整数倍, 其他情况填 0.00。

→	10195	DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	若为换入, 则填 1 若为换出, 则填 2	不需要填写	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
→	10206	UnderlyingShareProperty	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
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券, 填质押证券券面总额, 单位为元; 换入时必须大于 0 且为万元的整数倍; 换出时必须大于 0 且为一元的整数倍; 其他情况填 0.0000。	不需要填写	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券, 填质押证券券面总额, 单位为元; 换入时必须大于 0 且为万元的整数倍; 换出时必须大于 0 且为一元的整数倍; 其他情况填 0.0000。	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券, 填质押证券券面总额, 单位为元; 换入时必须大于 0 且为万元的整数倍; 换出时必须大于 0 且为一元的整数倍; 其他情况填 0.0000。
组件结束							

表 4-9 提前终止委托消息定义

Tag	域名	字段描述	发起方成交请求 字段取值	发起方主动撤单委托 字段取值	响应方点击成交申报 (同意成交) 字段取值	响应方点击成交申报 (拒绝成交) 字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报

			申报			
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	1064=提前终止	1064=提前终止	1064=提前终止	1064=提前终止
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	不需要填写	被撤委托的客户成交申报编号	填响应方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填响应方接收的转发成交申报的客户成交申报编号

		撤销成交申报时使用 对于成交请求模式，响 应方填写转发成交申 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	标的证券代码	全空格	标的证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
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	发起方交易单元，需 与本方交易单元一致	发起方交易单元，需与本 方交易单元一致	发起方交易单元，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	1	1	
→	54	Side 买卖方向 2=借入方 1=借出方	发起方的方向：1、2	发起方的方向：1、2	响应方的方向：2、1	响应方的方向：2、1	响应方的方向：2、1	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
	→	448	PartyID	参与人代码	发起方交易单元	发起方交易单元	响应方交易单元	响应方交易单元
		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	发起方证券账户	发起方证券账户	响应方证券账户	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	发起方营业部代码	发起方营业部代码	响应方营业部代码	响应方营业部代码
		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	发起方交易商代码	发起方交易商代码	响应方交易商代码	发起方交易商代码	
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	发起方交易主体代码	发起方交易主体代码	响应方交易主体代码	响应方交易主体代码
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	发起方交易主体类型	发起方交易主体类型	响应方交易主体类型
	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	发起方交易员代码	发起方交易员代码	响应方交易员代码	响应方交易员代码
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码
448	PartyID	参与人代码	响应方交易商代码	响应方交易商代码	发起方交易商代码	发起方交易商代码
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	响应方交易主体代码	响应方交易主体代码	发起方交易主体代码	发起方交易主体代码
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	响应方交易主体类型	响应方交易主体类型	发起方交易主体类型
		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	响应方交易员代码	响应方交易员代码	发起方交易员代码	发起方交易员代码
	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	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为基础设施基金, 填归还的标的券数量, 单位为份, 必须为一份的整数倍; 其他情况填 0.00。	填 0.00	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为基础设施基金, 填归还的标的券数量, 单位为份, 必须为一份的整数倍; 其他情况填 0.00。	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为基础设施基金, 填归还的标的券数量, 单位为份, 必须为一份的整数倍; 其他情况填 0.00。
664	ConfirmID		约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。
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

737	AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写	不需要填写	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写
381	CashOrderQty	标的证券券面总额	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况无需填写。	不需要填写	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况无需填写。	若标的证券已摘牌，必须填 0；如果标的证券为债券或者资产支持证券，填归还的标的证券券面总额，单位为元，必须为一元的整数倍；其他情况无需填写。
8904	SubstCash	现金结算金额	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。	不需要填写	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。	若借入方无法返还约定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金额	提前终止的借贷费用，若为 0 则不需要填写。	不需要填写	提前终止的借贷费用，若为 0 则不需要填写。	提前终止的借贷费用，若为 0 则不需要填写。
119	SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	提前终止的借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。	不需要填写	提前终止的借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。	提前终止的借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。
10245	SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定

表 4-10 质押券变更委托消息定义

Tag	域名	字段描述	借入方成交请求 字段取值	借入方主动撤单委托 字段取值	借出方点击成交申报（同 意成交）字段取值	借出方点击成交申 报（拒绝成交）字段 取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交 申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申 报
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	1066=质押券变更	1066=质押券变更	1066=质押券变更	1066=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	3	3	3	3

		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, 借出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	填借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	填借出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=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
	→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
		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	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	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	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码
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	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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< PtypSubGrp>						
802	NoPartySubIDs	参与方子代码个数	1	1	1	1
→	523	PartySubID	参与方子代码	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码
448	PartyID	参与人代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
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	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码

	447	PartyIDSource	参与者代码源	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	参与者代码角色	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	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
	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	参与者代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
	447	PartyIDSource	参与者代码源	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	参与者代码角色	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	填 0.0000
32	LastQty	数量	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00	填 0.00
737	AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	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	换出金额, 若为 0 则不需要填写
664	ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空;	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空;	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空;

			其他填充格。			其他填充格。
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
381	CashOrderQty	标的证券券面总额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8904	SubstCash	现金结算金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
119	SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10245	SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定
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	如果质押证券、解押证券为基础设施基金, 填质押证券、解押证券数量, 单位为	不需要填写	如果质押证券、解押证券为基础设施基金, 填质押证券、解押证券数量, 单位为份, 必须大于 0 且为万份的整数

				份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。		倍，其他情况填 0.00。	份，必须大于 0 且为万份的整数倍，其他情况填 0.00。
→	10195	DeliverySide	方向 1=质押 2=解押	若为换入，则填 1 若为换出，则填 2	不需要填写	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
→	10206	UnderlyingShareProperty	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
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	不需要填写	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。	如果质押、解押证券为债券或者资产支持证券，填质押证券券面总额，单位为元；换入时必须大于 0 且为万元的整数倍；换出时必须大于 0 且为一元的整数倍；其他情况填 0.0000。
组件结束							

表 4-11 解除质押委托消息定义

Tag	域名	字段描述	借入方成交请求字段取值	借入方主动撤单委托字段取值	借出方点击成交申报（同意成交）字段取值	借出方点击成交申报（拒绝成交）字段取
-----	----	------	-------------	---------------	---------------------	--------------------

						值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
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	1065=解除质押	1065=解除质押	1065=解除质押	1065=解除质押
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	3	3	3	3

		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, 借出方填写转发成交 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	填借出方接收的转发成交 申报的客户成交申报编号	填借出方接收的转发 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	1	
→	54	Side	买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
	→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
		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	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	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	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码
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	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码
448	PartyID	参与人代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
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	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
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	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型
		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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
	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
737	AllocSettlCurrAmt		现金结算场内支付金额	解除质押金额, 若为 0 则不需要填写	不需要填写	解除质押金额, 若为 0 则需要填写	解除质押金额, 若为 0 则不需要填写
664	ConfirmID		约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填充格。	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填充格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填充格。
880	TrdMatchID		初始交易编号, 跨交	对应初始交易的交易编	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

		易日唯一	号			编号
381	CashOrderQty	标的证券券面总额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8904	SubstCash	现金结算金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
119	SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10245	SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定

表 4-12 到期结算委托消息定义

Tag	域名	字段描述	借入方成交请求字段取值	借入方主动撤单委托字段取值	借出方点击成交申报（同意成交）字段取值	借出方点击成交申报（拒绝成交）字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE				
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
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	1062=到期结算	1062=到期结算	1062=到期结算	1062=到期结算
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, 借出方填写转发成交申报的客户	不需要填写	被撤委托的客户成交申报编号	借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号	借出方接收的转发成交申报的客户成交申报编号

		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	归还标的证券代码	全空格	归还标的证券代码	归还标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102	全空格	102	102
组件结束						
组件<RootParties>						
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2			
→	1117	RootPartyID	参与人代码	借入方交易单元,需与本方交易单元一致	借入方交易单元,需与本方交易单元一致	借出方交易单元,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	1		
→	54	Side	买卖方向	2=借入方	2=借入方	1=借出方	1=借出方	
	组件<Parties>							
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	9	9	9	8	
	→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易单元	借入方交易单元	借出方交易单元	借出方交易单元
		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	借入方证券账户	借入方证券账户	借出方证券账户	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	借入方营业部代码	借入方营业部代码	借出方营业部代码	借出方营业部代码
		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	借入方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
		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	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
		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	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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	借入方交易员代码	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借出方交易员代码
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	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码	12: 交易员代码
448	PartyID		参与人代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借入方交易商代码
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	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借入方交易主体代码
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	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借入方交易主体类型
	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	借出方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码

	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	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
32	LastQty	数量	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 若标的证券为基础设施基金, 填归还的标的证券数量, 单位为份, 且必须为万份的整数倍; 其他情况填 0.00	0.00	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 若标的证券为基础设施基金, 填归还的标的证券数量, 单位为份, 且必须为万份的整数倍; 其他情况填 0.00	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 若标的证券为基础设施基金, 填归还的标的证券数量, 单位为份, 且必须为万份的整数倍; 其他情况填 0.00	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 若标的证券为基础设施基金, 填归还的标的证券数量, 单位为份, 且必须为万份的整数倍; 其他情况填 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	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	对应初始交易的交易编号
664	ConfirmID	约定号	对方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	不需要填写	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。	本方交易主体类型为“机构经纪”时, 填约定号, 必须不为空; 其他填空格。
381	CashOrderQty	标的证券券面总额	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券面总额, 单位为元, 必须为一元的整数倍; 其他填 0.0000。	0.000	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券面总额, 单位为元, 必须为一元的整数倍; 其他填 0.0000。	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券面总额, 单位为元, 必须为一元的整数倍; 其他填 0.0000。	若标的证券已摘牌, 必须填 0; 如果标的证券为债券或者资产支持证券, 填标的证券券面总额, 单位为元, 必须为一元的整数倍; 其他填 0.0000。
8904	SubstCash	现金结算金额	若借入方无法返还约	不需要填写	若借入方无法返还约	若借入方无法返还约	若借入方无法返还约

			定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。		定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。	定足额标的债券，可与借出方协商通过现金补足差额或全部以现金结算，若为 0 则不需要填写。
737	AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写	不需要填写	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写	通过场内支付的现金结算金额，若为 0 则不需要填写
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
119	SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。	不需要填写	借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。	借贷费用场内支付金额，若为 0 则不需要填写。
10245	SupplementaryAgreement	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定	补充约定

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。交易系统在如下三种情形下会生成转发成交申报报文：

情形一：接收到发起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响应方；

情形二：接收到响应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发起方，通知发起方已发起的成交请求申报被响应方拒绝；

情形三：在响应方确认或拒绝之前，接收到发起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响应方。

如下 Binary、STEP 取值描述中原委托特指发起方的成交申报委托。

5.1 Binary 接口转发成交申报

表 5-1 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
Standard Header	消息头 MsgType=204220			
ReportIndex	回报记录号			
ApplID	应用标识	420: 债券借贷 转发成交申报	420: 债券借贷 转发成交申报	420: 债券借贷 转发成交申报
ReportingPBUID	回报交易单元	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
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
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
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
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
TransactTime	回报时间	转发成交申报	转发成交申报	转发成交申报

		生成时间	生成时间	生成时间
UserInfo	用户私有信息	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	被拒绝的发起方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去重后展示	发起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
TradeReportType	成交申报类型	1	3	1
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
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
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	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
LastPx	价格	原委托的价格	原委托的价格	原委托的价格
LastQty	数量	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止时, 若证券代码为债券、资产支持证券, 填标的证券券面总额/标的券实际面值, 除不尽时截断; 其余与原成交申报一致	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止时, 若证券代码为债券、资产支持证券, 填标的证券券面总额/标的券实际面值, 除不尽时截断; 其余与原成交申报一致	原委托的数量
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
TrdSubType	成交申报业务子类	原委托的成交申报业务子类	原委托的成交申报业务子类	原委托的成交申报业务子类

	预留	别	别	别
ConfirmID	约定号	当发起方委托的对手方交易主体类型为机构经纪或个人经纪时,与原成交申报一致;其他情况填全空格	当响应方委托的本手方交易主体类型为机构经纪或个人经纪时,与原成交申报一致;其他情况填全空格	原委托的约定号
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
PBUID	本方交易单元	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
BranchID	本方营业部代码	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
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	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
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
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
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
InvestorName	本方客户名称	原委托的本方交易客户名称	原委托的本方交易客户名称	原委托的本方交易客户名称
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
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	原委托的对手方交易商代码
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	原委托的对手方交易主体类型
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代	原委托的对手	原委托的对手	原委托的对手

	码	方交易主体代 码	方交易主体代 码	方交易主体代 码
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	原委托的对手 方交易客户名 称	原委托的对手 方交易客户名 称	原委托的对手 方交易客户名 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	原委托的对手 方交易员代码
TrdMatchID	交易编号，跨交易 日唯一	到期结算、到 期续做、提前 终止、解除质 押、质押券变 更时需填写原 委托对应交易 编号；其他情 况下填空	到期结算、到 期续做、提前 终止、解除质 押、质押券变 更时需填写原 委托对应交易 编号；其他情 况下填空	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
CashOrderQty	标的证券券面总额	初始交易、到 期续做，且标 的券为基础设 施基金，填标 的证券数量* 标的证券昨收 价；其余与原 成交申报一致	初始交易、到 期续做，且标 的券为基础设 施基金，填标 的证券数量* 标的证券昨收 价；其余与原 成交申报一致	原委托的标的 证券券面总额
SubstCash	现金结算金额	原委托的现金 结算金额	原委托的现金 结算金额	原委托的现金 结算金额
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付 金额	原委托的现金 结算场内支付 金额	原委托的现金 结算场内支付 金额	原委托的现金 结算场内支付 金额
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	参见说明（2）	参见说明（2）	原委托的借贷 费用金额
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付 金额	原委托的借贷 费用场内支付 金额	原委托的借贷 费用场内支付 金额	原委托的借贷 费用场内支付 金额
GracePeriod	申报宽限期	原委托的申报 宽限期	原委托的申报 宽限期	原委托的申报 宽限期
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	原委托的补充 约定长度	原委托的补充 约定长度	原委托的补充 约定长度
SupplementaryAgreement	补充约定	原委托的补充 约定	原委托的补充 约定	原委托的补充 约定
NoSecurity	质押券个数	原委托的质押	原委托的质押	原委托的质押

			券个数	券个数	券个数
→	UnderlyingSecurityID	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
→	UnderlyingSecurityIDSource	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
→	DeliveryQty	数量	初始交易、到期续做、质押券变更时,若质押或解押券代码为债券、资产支持证券,填质押或解押券券面总额/质押或解押券实际面值,除不尽时截断;其余与原委托一致	初始交易、到期续做、质押券变更时,若质押或解押券代码为债券、资产支持证券,填质押或解押券券面总额/质押或解押券实际面值,除不尽时截断;其余与原委托一致	原委托的数量
→	DeliverySide	方向	原委托的方向	原委托的方向	原委托的方向
→	UnderlyingShareProperty	股份性质	原委托的股份性质	原委托的股份性质	原委托的股份性质
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	原委托的质押券券面总额	原委托的质押券券面总额	原委托的质押券券面总额

说明:

(1) ReportingPBUID (回报交易单元), 在情形一、情形三下, 当成交申报类型为初始交易时, 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、提前终止、到期续做、解除质押、到期结算时, 填写为在途合约对应的对手方交易单元, 即, 最近一次初始交易或到期续做达成成交时对手方使用的本方交易单元; 在情形二下, 填写为被拒绝的借入方对应委托的申报交易单元。

(2) 转发借入方的到期续做、到期结算请求给借出方时, 交易所计算借贷费用金额并填入借贷费用金额 (AccruedInterestAmt) 字段, 供对手方参考; 转发发起方

的提前终止请求给对手方时,需填写原委托的借贷费用金额(AccruedInterestAmt)字段;其他情况填 0.0000;

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
	MessageHeader	MsgType=AE			
10179	ReportIndex	回报记录号			
1180	ApplID	应用标识	420: 债券借贷转发成交申报	420: 债券借贷转发成交申报	420: 债券借贷转发成交申报
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	被拒绝的发起方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
571	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去重后展示	发起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
522	OwnerType	成交申报所有者类型	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
856	TradeReportType	成交申报类型	1	3	1
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
664	ConfirmID	约定号	当发起方委托的对手方交易主体类	当响应方委托的本手方交易主体类	原委托的约定号

			型为机构经纪或个人经纪时,与原成交申报一致;其他情况填全空格	型为机构经纪或个人经纪时,与原成交申报一致;其他情况填全空格	
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
572	TradeReportRefID	原客户成交申报编号	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
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
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
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
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	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
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	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
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	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

组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	NoSides		side 个数	1	1	1	
→	54	Side	买卖方向	2=借入方	1=借出方	2=借入方	
	组件<Parties>						
	453	NoPartyIDs		参与人代码 个数	7	7	7
	→	448	PartyID	参与人代码	借入方交易 商代码	借出方交易 商代码	借入方交易 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	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	借入方交易 主体代码	借出方交易 主体代码	借入方交易 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
		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
	子组件<PtysSubGrp>						
	802	NoPartySubIDs		参与方子代 码个数	借入方客户 名称 当借入方交 易主体类型 为 03=机构 经纪时, 填 2; 否则填 1	借出方客户 名称 当借出方交 易主体类型 为 03=机构 经纪时, 填 1; 否则不需 要填写	借入方客户 名称 当借入方交 易主体类型 为 03=机构 经纪时, 填 2; 否则填 1
	→	523	PartySubID	参与方子代 码	借入方交易 主体类型	借出方交易 主体类型	借入方交易 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	借入方客户 名称 当借入方交 易主体类型 为 03=机构 经纪时, 填	借入方客户 名称 当借入方交 易主体类型 为 03=机构 经纪时, 填	借入方客户 名称 当借入方交 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	写正方客户名称；否则不需要填写	写正方客户名称；否则不需要填写
	803	PartySubIDType	参与方子代码类型	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 03=机构经纪时，填写“5=本方客户名称”；否则不需要填写	借入方客户名称 当借入方交易主体类型为 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	借入方交易员代码	借出方交易员代码	借入方交易员代码	借入方交易员代码
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
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
448	PartyID		参与人代码	借出方交易商代码	借入方交易商代码	借出方交易商代码	借出方交易商代码
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=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	借出方交易主体代码	借入方交易主体代码	借出方交易主体代码	借出方交易主体代码
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
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
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	借出方交易主体类型	借入方交易主体类型	借出方交易主体类型	借出方交易主体类型
	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

		子组件< PtysSubGrp>				
	448	PartyID	参与人代码	借出方交易 员代码	借入方交易 员代码	借出方交易 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
	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
		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
31		LastPx	成交价格	原委托的价 格	原委托的价 格	原委托的价 格
32		LastQty	成交数量	初始交易、到 期结算、到期 续做、提前终 止时,若证券 代码为债券、 资产支持证 券,填标的证 券券面总额/ 标的券实际 面值,除不尽 时截断;其余 与原成交申 报一致	初始交易、 到期结算、 到期续做、 提前终止 时,若证券 代码为债 券、资产支 持证券,填 标的证券券 面总额/标 的券实际面 值,除不尽 时截断;其 余与原成交 申报一致	原委托的成 交数量
737		AllocSettlCurrAmt	现金结算场 内支付金额	原委托的现 金结算场内 支付金额	原委托的现 金结算场内 支付金额	原委托的现 金结算场内 支付金额
119		SettlCurrAmt	借贷费用场 内支付金额	不需要填写	不需要填写	不需要填写
8911		ExpirationDays	期限	原委托的期 限	原委托的期 限	原委托的期 限

381		CashOrderQty	标的证券券面总额	初始交易、到期续做,且标的券为基础设施基金,填标的证券数量*标的证券昨收价;其余与原成交申报一致	初始交易、到期续做,且标的券为基础设施基金,填标的证券数量*标的证券昨收价;其余与原成交申报一致	原委托的标的证券券面总额
8904		SubstCash	现金结算金额	原委托的现金结算金额	原委托的现金结算金额	原委托的现金结算金额
159		AccruedInterestAmt	借贷费用金额	参见说明(2)	参见说明(2)	原委托的借贷费用金额
880		TrdMatchID	初始交易编号,跨交易日唯一	到期结算、到期续做、提前终止、解除质押、质押券变更时需填写原委托对应交易编号;其他情况下填空	到期结算、到期续做、提前终止、解除质押、质押券变更时需填写原委托对应交易编号;其他情况下填空	原委托的初始交易编号
10244		GracePeriod	申报宽限期	原委托的申报宽限期	原委托的申报宽限期	原委托的申报宽限期
10245		SupplementaryAgreement	补充约定	原委托的补充约定	原委托的补充约定	原委托的补充约定
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
→	309	UnderlyingSecurityID	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
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	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
→	8903	DeliveryQty	数量	初始交易、到期续做、质押券变更时,若质押或解押券代码为债	初始交易、到期续做、质押券变更时,若质押或解押券代	原委托的数量

				券、资产支持 证券,填质押 或解押券券 面总额/质押 或解押券实 际面值,除不 尽时截断;其 余与原委托 一致	码为债券、 资产支持证 券,填质押 或解押券券 面总额/质押 或解押券实 际面值,除 不尽时截 断;其余与 原委托一致	
→	10195	DeliverySide	方向	原委托的方 向	原委托的方 向	原委托的方 向
→	10206	UnderlyingShareProperty	股份性质	原委托的股 份性质	原委托的股 份性质	原委托的股 份性质
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面 总额	原委托的质 押券券面总 额	原委托的质 押券券面总 额	原委托的质 押券券面总 额
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	主动撤单失败成交申报响应字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=204204			
ReportIndex	回报记录号			
ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
ReportingPBUID	回报交易单元	债券借贷委托申报交易单元	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	债券借贷委托申报交易单元	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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	交易所为债券借贷委托分配的唯一 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	债券借贷委托申	主动撤单委托	主动撤单委

	号	报对应字段值	申报对应字段值	托申报对应字段值
TradeReportType	成交申报类型	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止, 若证券代码为债券、资产支持证券, 填标的证券券面总额/标的券实际面值, 除不尽时截断; 其余与原委托一致。	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止, 若证券代码为债券、资产支持证券, 填被撤委托的标的证券券面总额/标的券实际面值, 除不尽时截断; 其余与被撤单委托一致。	主动撤单委托申报对应字段值

TrdType	成交申报业务类别	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	本方参与者买卖方向	债券借贷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
PBUID	本方交易单元	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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
TradeReportRejectText	拒绝原因说明	当撤单原因代码是“20031-配对失败”、“20022-股份卖空”、“20143-无效交易主体”、“20144-无效交易员”、“20111-无效交易单元”、“20010-质押券数量单位失败”、“20162-质押券券面总额非法”，填写失败原因；其他填全空格	全空格	全空格

MemberID	本方交易商代码	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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
TrdMatchID	交易编号，跨交易日唯一	债券借贷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	债券借贷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	标的证券券面总额	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填标的证券数量*标的证券昨收价；其余与原成交申报一致	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填被撤单委托标的证券数量*标的证券昨收价；其余与被撤单委托一致	主动撤单委托申报对应字段值
SubstCash	现金结算金额	债券借贷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

AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	债券借贷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	
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	债券借贷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	借贷费用场内支付金额	债券借贷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	
GracePeriod	申报宽限期	债券借贷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	
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	债券借贷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	
SupplementaryAgreement	补充约定	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	初始交易、到期续做、质押券变更时，若质押券代码为债券、资产支持证券，填质押券券面总额/质押券实际面值，除不尽时截断； 其余与原委托一致	初始交易、到期续做、质押券变更时，若质押券代码为债券、资产支持证券，填被撤单委托质押券券面总额/质押券实际面值，除不尽时截断； 其余与被撤单委托一致	主动撤单委托申报对应字段值
→	DeliverySide	方向	债券借贷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
→	UnderlyingShareProperty	股份性质	债券借贷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
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	债券借贷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	主动撤单失败成交申报响应字段取值
	MessageHeader	MsgType=AR			
10179	ReportIndex	回报记录号			
1180	ApplID	应用标识	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报	420=债券借贷成交申报
1003	TradeID	交易所为成交申报分配的唯一 ID	交易所为债券借贷委托分配的唯一 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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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
10240	TradeReportRejectText	拒绝原因说	当撤单原因代码是	全空格	全空格

			明	“20031-配对失败”、“20022-股份卖空”、“20143-无效交易主体”、“20144-无效交易员”、“20111-无效交易单元”、“20010-质押券数量单位失败”、“20162-质押券券面总额非法”，填写失败原因；其他填全空格		
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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷委托申报对应字段值	被撤单委托申报对应值
		803	PartySubIDType	参与方子代码类型	债券借贷委托申报对应字段值	被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	债券借贷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	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止，若证券代码为债券、资产支持证券，填标的证券券面总额/标的券实际面值，除不尽时截断；其余与原委托一致。	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止，若证券代码为债券、资产支持证券，填被撤委托的标的证券券面总额/标的券实际面值，除不尽时截断；其余与被撤单委托一致。	主动撤单委托申报对应值
737	AllocSettlCurrAmt		现金结算场内支付金额	债券借贷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	债券借贷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		期限	债券借贷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	债券借贷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
10244	GracePeriod		申报宽限期	债券借贷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
10245	SupplementaryAgreement		补充约定	债券借贷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
381	CashOrderQty		标的证券券面总额	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填标的证券数量*标的证券昨	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填被撤单委	主动撤单委托申报对应值

				收价; 其余与原成交申报 一致	托标的证券数量 *标的证券昨收 价; 其余与被撤 单委托一致	
8904	SubstCash	现金结算金 额		债券借贷委托申报 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
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金 额		债券借贷委托申报 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
119	SettlCurrAmt	借贷费用场 内支付金额		债券借贷委托申报 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		债券借贷委托申报 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	债券借贷委托申报 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	债券借贷委托申报 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	初始交易、到期续 做、质押券变更时, 若质押券代码为债 券、资产支持证券, 填质押券券面总额/ 质押券实际面值,除 不尽时截断; 其余与原委托一致	初始交易、到期 续做、质押券变 更时,若质押券 代码为债券、资 产支持证券,填 被撤单委托质押 券券面总额/质 押券实际面值,除 不尽时截断; 其余与被撤单委 托一致	主动撤单委托申 报对应值
→	10195	DeliverySide	方向	债券借贷委托申报 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
→	10206	UnderlyingShareProperty	股份性质	债券借贷委托申报 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
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面 总额	债券借贷委托申报 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=204203	

ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	420: 债券借贷
ReportingPBUID	回报交易单元	债券借贷委托申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	债券借贷委托申报交易单元
SecurityID	证券代码	债券借贷委托申报对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	债券借贷委托申报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	债券借贷委托申报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷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	债券借贷委托申报对应字段值
LastQty	数量	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止时，若证券代码为债券、资产支持证券，填标的券面总额/标的券实际面值，除不尽时截断；其余与原委托一致
TrdType	成交申报业务类别	债券借贷委托申报对应字段值
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	债券借贷委托申报对应字段值

ConfirmID	约定号	债券借贷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	债券借贷委托申报对应字段值
PBUID	本方交易单元	债券借贷委托申报对应字段值
AccountID	本方证券账户	债券借贷委托申报对应字段值
BranchID	本方营业部代码	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	债券借贷委托申报对应字段值
MemberID	本方交易商代码	债券借贷委托申报对应字段值
InvestorType	本方交易主体类型	债券借贷委托申报对应字段值
InvestorID	本方交易主体代码	债券借贷委托申报对应字段值
InvestorName	本方客户名称	债券借贷委托申报对应字段值
TraderCode	本方交易员代码	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyMemberID	对手方交易商代码	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorType	对手方交易主体类型	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorID	对手方交易主体代码	债券借贷委托申报对应字段值
CounterpartyInvestorName	对手方客户名称	初始交易：与对手方申报的 InvesotrMame 一致； 其他：与原委托一致
CounterpartyTraderCode	对手方交易员代码	债券借贷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	债券借贷委托申报对应字段值
CashOrderQty	标的证券券面总额	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填标的证券数量*标的证券昨收价；其余与原成交申报一致
SubstCash	现金结算金额	债券借贷委托申报对应字段值
AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	债券借贷委托申报对应字段值
AccruedInterestAmt	借贷费用金额	到期续做、到期结算时，填交易系统计算的到借贷费用金额（参见说明（2））；其余与原成交申报一致。
SettlCurrAmt	借贷费用场内支付金额	债券借贷委托申报对应字段值
GracePeriod	申报宽限期	债券借贷委托申报对应字段值
SupplementaryAgreementLen	补充约定长度	债券借贷委托申报对应字段值
SupplementaryAgreement	补充约定	债券借贷委托申报对应字段值
NoSecurity	质押券个数	债券借贷委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityID	原委托的证券代码	债券借贷委托申报对应字段值
→ UnderlyingSecurityIDSource	原委托的证券代码源	债券借贷委托申报对应字段值
→ DeliveryQty	原委托的数量	初始交易、到期续做、质押券变更时，若质押券代码为债券、资产支持证券，填质押券券面总额/质押券实际面值，除不尽时截断；其余与原委托一致
→ DeliverySide	原委托的方向	债券借贷委托申

			报对应字段值
→	UnderlyingShareProperty	原委托的股份性质	债券借贷委托申报对应字段值
→	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面总额	债券借贷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,其它与原债券借贷委托的交易编号一致。

(2) AccruedInterestAmt(借贷费用金额),若为到期购回、到期续做,填交易系统计算的借贷费用金额,对于多次续做场景,借贷费用计算的基准为上一次续做合约的标的证券券面总额。

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	420: 债券借贷
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	债券借贷委托申报对应字段值
522	OwnerType	成交申报所有者类型	债券借贷委托申报对应字段值
828	TrdType	成交申报业务类别	债券借贷委托申报对应字段值
856	TradeReportType	成交申报类型	债券借贷委托申报对应字段值
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	债券借贷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	债券借贷委托申报对应字段值

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

32	LastQty	成交数量	初始交易、到期结算、到期续做、提前终止时，若证券代码为债券、资产支持证券，填标的券券面总额/标的券实际面值，除不尽时截断；其余与原委托一致
737	AllocSettlCurrAmt	现金结算场内支付金额	债券借贷委托申报对应字段值
664	ConfirmID	约定号	债券借贷委托申报对应字段值
8911	ExpirationDays	期限	债券借贷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	借贷费用场内支付金额	参见说明（2）
10244	GracePeriod	申报宽限期	债券借贷委托申报对应字段值
10245	SupplementaryAgreement	补充约定	债券借贷委托申报对应字段值
381	CashOrderQty	标的证券券面总额	初始交易、到期续做，且标的券为基础设施基金，填标的证券数量*标的证券昨收价；其余与原成交申报一致
8904	SubstCash	现金结算金额	债券借贷委托申报对应字段值
159	AccruedInterestAmt	借贷费用金额	到期续做、到期结算时，填交易系统计算的到借贷费用金额（参见说明（2））；其余与原成交申报一致。
组件<CompDeliverSecurity>			
8902	NoSecurity	质押券个数	债券借贷委托申报对应字段值
→	309	UnderlyingSecurityID	债券代码

				对应字段值
→	305	UnderlyingSecurityIDSource	证券代码源	债券借贷委托申报 对应字段值
→	8903	DeliveryQty	数量	初始交易、到期续 做、质押券变更时， 若质押券代码为债 券、资产支持证券， 填质押券券面总额 /质押券实际面值， 除不尽时截断； 其余与原委托一致
→	10195	DeliverySide	方向	债券借贷委托申报 对应字段值
→	10206	UnderlyingShareProperty	股份性质	债券借贷委托申报 对应字段值
→	10241	UnderlyingCashOrderQty	质押券券面 总额	债券借贷委托申报 对应字段值
组件结束				

说明：

在初始交易时，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，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、开展债券借贷业务的券商系统注意事项

9.1 行情相关说明

债券借贷的证券基本资料已在证券信息 securities.xml 中挂牌,但到期结算或提前终止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;债券借贷的委托、成交不会反映到实时行情信息中。

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,以支持债券借贷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借贷交易相关业务规则。证券公司应当实施相应的借入方、借出方适当性管理,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

接受借入方、借出方债券借贷的委托指令后,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。

◇ 向深交所申报委托前合约到期日控制

申报初始交易和到期续做时，证券公司应当检查合约到期日为交易日。

十、 联系方式

技术咨询：0755-88668514

业务咨询：0755-88668447

附件一、债券借贷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

对于深市债券借贷（以下简称“债券借贷”）业务，新增以下的业务类别：

业务类别	业务类别名称
JDCS	债券借贷初始交易
JDTG	债券借贷提前终止
JDDQ	债券借贷到期结算
JDXZ	债券借贷到期续做
JDJZ	债券借贷解除质押
JDBG	债券借贷变更质押券
JDHY	债券借贷在途合约

对于‘JDCS’、‘JDTG’、‘JDDQ’、‘JDXZ’、‘JDJZ’业务，结算系统采用 RTGS 或 T+0 日末逐笔非担保交收方式进行交收处理，对于‘JDBG’业务，采用 T+0 日末逐笔非担保交收方式。

初始交易时，结算系统将标的证券从借出方过户至借入方，同时将借入方质押证券在借入方的托管单元上进行质押冻结。到期结算、提前终止、解除质押时，结算系统将标的证券从借入方过户至借出方（解除质押除外），同时将质押证券及孳息解除质押冻结。到期续做时，将标的证券按照根据新老合约标的证券数量计算出的交收数量进行过户，同时将换入的质押证券进行质押冻结，将换出的质押证券进行解除质押冻结。变更质押券时，结算系统对于换入的质押证券进行质

押冻结,对于换出的质押证券或资金进行解除质押冻结。结算系统每日通过‘JDHY’发送债券借贷在途合约。相关质押证券及孳息的冻结、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债券借贷质押冻结的证券数量。

使用 SJSMX0.DBF 和 SJSJG.DBF 分别表示债券借贷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。

债券借贷质押明细信息通过 SJSFW.DBF 中数据类别为‘11’的数据发送给借入方,并通过数据类别‘13’的数据发送给借出方。

SJSMX0.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)。

债券借贷的初始交易、提前终止、到期结算、到期续做、解除质押的逐笔清算采用 SJSMX0.DBF 中的‘JDCS’、‘JDTG’、‘JDDQ’、‘JDXZ’、‘JDJZ’业务类别。对于‘JDCS’、‘JDXZ’业务,清算数据仅发送标的证券相关数据,不包含申报的质押证券数据。

SJSMX0.DBF 具体请参见下表:

字段名	业务类别		
	JDCS (债券借贷初始交易)	JDTG (债券借贷提前终止)	JDDQ (债券借贷到期结算)
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	‘JDCS’	‘JDTG’	‘JDDQ’
MXZQDM	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
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

字段名	业务类别		
	JDCS (债券借贷初始交易)	JDTG (债券借贷提前终止)	JDDQ (债券借贷到期结算)
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
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 为借入方时>0; 为借出方时<0;	成交数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	成交数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;
MXQSSL	清算数量 为借入方时>0; 为借出方时<0;	清算数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	清算数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;
MXCJG	年化利率	0	0
MXQSJG	年化利率	0	0
MXXYJY			
MXPCBS			
MXZQLB	标的证券类别	标的证券类别	标的证券类别
MXZQZL	标的证券子类别	标的证券子类别	标的证券子类别
MXGFXZ	标的证券股份性质	标的证券股份性质	标的证券股份性质
MXJSFS	'R'	'R'	'R'
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ		现金结算场内支付金额	现金结算场内支付金额
MXYHS			
MXJYJSF		交易经手费	交易经手费
MXJGGF			
MXGHF			
MXJSF		结算费	结算费
MXSXF			
MXQSYJ			
MXQTFY			
MXZJJE		借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额
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

字段名	业务类别		
	JDCS (债券借贷初始交易)	JDTG (债券借贷提前终止)	JDDQ (债券借贷到期结算)
MXQTRQ	到期日期		
MXSCDM			
MXJYFS	'13'	'13'	'13'
MXZQDM2			
MXTGDY2			
MXDDBH2			
MXCWDH	错误代号	错误代号	错误代号
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			

字段名	业务类别	
	JDJZ (债券借贷解除质押)	JDXZ (债券借贷到期续做)
MXJSZH	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'
MXYWLB	'JDJZ'	'JDXZ'
MXZQDM	标的证券代码	标的证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	0	成交数量(新合约标的证券数量) 为借入方时>0; 为借出方时<0;
MXQSSL	0	清算数量 为借入方时=新合约

字段名	业务类别	
	JDJZ (债券借贷解除质押)	JDXZ (债券借贷到期续做)
		成交数量-老合约成交数量; 为借出方时=老合约成交数量-新合约成交数量;
MXCJG	0	年化利率
MXQSJG	0	年化利率
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	标的证券类别	标的证券类别
MXZQZL	标的证券子类别	标的证券子类别
MXGFXZ	标的股份性质	标的股份性质
MXJSFS	‘R’	‘R’
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ	解除质押结算金额 为借入方时 ≤ 0 ; 为借出方时 ≥ 0 ;	
MXYHS		
MXJYJSF	交易经手费	
MXJGGF		
MXGHF		
MXJSF	结算费	结算费
MXSXF		
MXQSYJ		
MXQTFY		
MXZJJE		借贷费用场内支付金额
MXSFJE	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ		到期日期
MXSCDM		
MXJYFS	‘13’	‘13’
MXZQDM2		
MXTGDY2		

字段名	业务类别	
	JDJZ (债券借贷解除质押)	JDXZ (债券借贷到期续做)
MXDDBH2		
MXCWDH	错误代号	错误代号
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)
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‘JDJZ’、‘JDXZ’、‘JDBG’业务，交收结果 T 日体现在 SJSJG.DBF 中。业务类别为‘JDHY’的数据表示参与者（包括借入方、借出方对应的参与者）下未了结的债券借贷合约。

对于‘JDJZ’、‘JDXZ’、‘JDBG’业务，JGYWLSH 不为空的记录表示交易指令交收结果，其中 JGJSSL（‘JDBG’业务除外）表示标的证券的实际变更数量；JGYWLSH 为空的记录表示相应的质押证券质押冻结或解除质押冻结的明细，其中 JGJSSL 并不表示股份的实际变更，只是在借入方原托管单元上冻结或解冻，借出方记录不表示冻结或解冻，仅供参考。质押证券的冻结、解冻也将体现在‘JDBG’中。

对于‘JDBG’业务的交收结果记录中的 JGQSBZ，表示申报的换出资金金额；对于‘JDJZ’、‘JDXZ’、‘JDBG’业务，其解除质押明细中的相关资金为解冻的质押资金明细，该部分资金也会体现在 SJSJG.DBF 的‘DJJZ’中。请参与人在账务处理时注意不能重复记账。

SJSJG.DBF 具体请参见下表：

字段名	业务类别		
	JDJZ (债券借贷初始交易)	JDXZ (债券借贷提前终止)	JDBG (债券借贷到期结算)
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	‘JDCS’	‘JDTG’	‘JDDQ’
JGZQDM	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
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
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	成交数量 为借入方时>0; 为借出方时<0;	成交数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	成交数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;
JGQSSL	清算数量 为借入方时>0; 为借出方时<0;	清算数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	清算数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;
JGJSSL	交收数量 为借入方时>0; 为借出方时<0;	交收数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	交收数量 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;
JGCJG	年化利率	0	0
JGQSJG	年化利率	0	0
JGXYYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	标的证券类别	标的证券类别	标的证券类别
JGZQZL	标的证券子类别	标的证券子类别	标的证券子类别
JGGFXZ	标的证券股份性质	标的证券股份性质	标的证券股份性质
JGLTLX	0	0	0
JGJSFS	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’	‘N’或‘R’
JGHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
JGQSBJ		现金结算场内支付金额	现金结算场内支付金额
JGYHS			
JGJYJSF		交易经手费	交易经手费
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF		结算费	结算费
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE		借贷费用场内支付金额	借贷费用场内支付金额
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	到期日期		
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		
	JDJZ（债券借贷解除质押）	JDXZ（债券借贷到期续做）	JDBG（债券借贷质押券变更）
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	‘JDJZ’	‘JDXZ’	‘JDBG’
JGZQDM	标的证券代码	标的证券代码	
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	
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	成交数量（新合约标的证券数量） 为借入方时>0; 为借出方时<0;	0
JGQSSL	0	清算数量 为借入方时=新合约成交数量-老合约成交数量; 为借出方时=老合约成交数量-新合约成交	0

		数量;	
JGJSSL	0	交收数量 为借入方时=新合约 成交数量-老合约成交 数量数量; 为借出方时=老合约 成交数量-新合约成交 数量;	0
JGCJG	0	年化利率	0
JGQSJG	0	年化利率	0
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	标的证券类别	标的证券类别	
JGZQZL	标的证券子类别	标的证券子类别	
JGGFXZ	标的证券股份性质	标的证券股份性质	
JGLTLX	'0'	'0'	
JGJSFS	'N'或'R'	'N'或'R'	'N'
JGHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
JGQSBJ	解除质押结算金额 为借入方时<=0; 为借出方时>=0;	0	委托换出的资金金额 为借入方时>=0; 为借出方时<=0;
JGYHS			
JGJYJSF	交易经手费		
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF	结算费	结算费	
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			质押券变更费
JGZJJE		借贷费用场内支付金 额	
JGSFJE	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+1 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ		到期日期	
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		
	JDCS/JDXZ/JDBG (债券借贷初始交易/ 到期续做/质押券变 更) 质押明细	JDDQ/JDTG/JDJZ/ DXZ/JDBG (债券借 贷到期购回/提前购回 /解除质押/到期续做/ 质押券变更) 解除质 押明细	JDHY (债券借贷合 约)
JGJSZH	结算账户	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'	'02'
JGYWLB	'JDCS'/'JDXZ' /'JDBG'	'JDDQ'/'JDTG'/'JDJZ' /'JDXZ'/'JDBG'	'JDHY'
JGZQDM	质押券证券代码	质押券证券代码	标的证券代码
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			
JGYYB			
JGZXBH			
JGYWLSH			
JGCJSL			初始交易标的证券成 交数量(对于到期续做 后的合约为新合约标 的证券成交数量) 为借入方时>0; 为借出方时<0;
JGQSSL			
JGJSSL	质押数量 为借入方时<0; 为借出方时>0;	解除质押数量 为借入方时>=0; 为借出方时<=0;	
JGCJJG			年化利率
JGQSJG			
JGXYYJ			
JGPCBS			

JGZQLB	质押券证券类别	质押券证券类别	
JGZQZL	质押券证券子类	质押券证券子类	
JGGFXZ	质押券股份性质	质押券股份性质	
JGLTLX	质押券流通类型	质押券流通类型	
JGJSFS			
JGHBDDH		货币代号	
JGQSBJ			
JGYHS			
JGJYJSF			
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF			
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE		若有资金,为解押资金 金额 为借入方时 ≥ 0 ; 为借出方时 ≤ 0 ;	
JGSFJE			
JGJSBZ	‘Y’	‘Y’	
JGZYDH			
JGCJRQ			初始成交日期(对于到 期续做后的合约为续 做成交日期)
JGQSRQ			
JGJSRQ			
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ			到期日期
JGSCDM			
JGJYFS			
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

债券借贷的质押明细数据通过数据类别‘11’和‘13’分别向借入方和借出方发送。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、债券借贷借出方质

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	
	11 (股份司法冻结/质押冻结明细)	13 (三方回购及协议回购逆回购方、债券借贷借出方质押明细)
FWSJLB	11	13
FWJSZH	结算账户	结算账户
FWBFZH		
FWTGDY	托管单元	托管单元 (三方回购及协议回购逆回购方、债券借贷借出方)
FWZQDM	证券代码	证券代码
FWZQZH	证券账户	证券账户 (三方回购及协议回购逆回购方、债券借贷借出方)
FWGFXZ	股份性质	股份性质
FWLTLX	流通类型	流通类型
FWMRJE	冻结本金	冻结本金
FWMCJE	冻结红利	冻结红利
FWZJYE	冻结数量	冻结数量
FWSL1		
FWSL2		
FWCLRQ		
FWFSRQ		
FWZYSM	<p>1-2 位表示冻结类型,定义见附录</p> <p>5-20 位填写业务流水号 (对于股票质押式回购、债券协议回购、三方回购和债券借贷为空)</p> <p>23-46 位表示冻结序号(对于股票质押式回购填写初始交易合同序号或补充质押合同序号;对于债券协议回购、三方回购和债券借贷,23-38 位填写初始交易编号)</p> <p>49 位表示是否为可售冻结('N':不可售冻结;'Y':可售冻结);</p> <p>52-75 位:若本笔冻结存在司法再冻结或司法标记,则填写司法再冻结序号或司法标记序号,其余为空;</p> <p>77-84 位:冻结截止日期,格式为 CCYYMMDD,若为 00010101 表</p>	<p>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,填 JD 表示为债券借贷</p> <p>5-20 位业务流水号填空</p> <p>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、或债券借贷初始交易编号</p> <p>49 位表示是否为可售冻结 (N:不可售冻结; Y:可售冻结)</p> <p>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</p> <p>77-84 位:冻结截止日期,格式为 CCYYMMDD,若为 00010101 表示无限期冻结</p>

字段名	数据类别	
	11 (股份司法冻结/质押冻结明细)	13 (三方回购及协议回购逆回购方、 债券借贷借出方 质押明细)
	示无限期冻结。	
FWBZSM	质权人或执行机关名称及案号，左对齐（对于股票质押式回购、债券质押式协议回购、三方回购和 债券借贷 为空）	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

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
JDDQ	债券借贷到期结算	QSZQDM 为债券借贷标的证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为现金结算场内支付金额及借贷费用场内支付金额； QSJSF 为结算费；QSJYJSF 为交易经手费。
JD TG	债券借贷提前终止	QSZQDM 为债券借贷标的证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为现金结算场内支付金额及借贷费用场内支付金额； QSJSF 为结算费；QSJYJSF 为交易经手费。
JD JZ	债券借贷解除质押	QSZQDM 为债券借贷标的证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为解除质押结算金额，QSJSF 为结算费； QSJYJSF 为交易经手费。

JDXZ	债券借贷到期续做	QSZQDM 为债券借贷标的证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期； QSMRJE+QSMCJE 为借贷费用场内支付金额，QSJSF 为结算费。
JDBG	债券借贷质押券变更费	QSZQDM 填写 ‘00RMB’ ； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1；QSSXF 为借贷质押券变更费

1.6 广播类信息库 SJSGB.DBF

新增的摘要代号通过 SJSGB 中广播类别为‘ZY’的数据发送。债券借贷业务涉及的摘要代号如下：

摘要代号	摘要代号名称
M64	债券借贷初始交易质押
M65	债券借贷提前终止解除质押
M66	债券借贷到期结算解除质押
M67	债券借贷到期续做变更质押券
M68	债券借贷解除质押指令解除质押
M69	债券借贷质押券变更指令变更质押券

二、 联系方式

技术咨询：0755-25946080

业务咨询：0755-21899255