



# 中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0065—2019

代替 JR/T 0065—2011

---

## 银行间市场基础数据元

Interbank market metadata

2019 - 01 - 08 发布

2019 - 01 - 08 实施

---

中国人民银行 发布



## 目 次

前言 .....	II
引言 .....	III
1 范围 .....	1
2 规范性引用文件 .....	1
3 术语和定义 .....	1
4 数据元的表示格式 .....	2
5 数据元的类目分组 .....	2
6 数据元目录 .....	2
参考文献 .....	182

## 前 言

本标准依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本标准代替JR/T 0065—2011《银行间市场基础数据元》，与JR/T 0065—2011相比主要技术变化如下：

- 修订数据元的表示格式，修改数据元类型，分为：文本、数值、日期和时间（见章节4，2011版的章节4）；
- 根据银行间日益丰富的业务场景和产品，对数据元条目进行重新分类，划分成：参与方、产品、事件、公共数据、条件、风险控制六大类（见章节5，2011版的章节5）；
- 挑选核心业务相关的数据元进行定义，对原标准数据元进行更新完善（见章节6，2011版的章节7）。

本标准由中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心提出。

本标准由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC 180）归口。

本标准负责起草单位：中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心。

本标准参加起草单位：中国人民银行科技司、银行间市场清算所股份有限公司、中央国债登记结算有限责任公司。

本标准主要起草人：许再越、姚前、杨富玉、朱荣、叶胜国、姜才康、王成勇、胡剑、李正、陈彬、胡卫平、沈峻、崔崑、郦永达、余波、冯蕾、孙小林、沈薇薇、茅廷、杨帆、蔡义杰、夏志江、吴燕、金月仙、卢艳民、孙英昊、包晓晶、赵俊锋、张洁、邓钢轶、周晓冬、李珏峰、魏成。

本标准于2011年6月2日首次发布，本次为第一次修订。

## 引 言

JR/T 0065—2011、JR/T 0066—2011、JR/T 0078—2014等银行间市场系列标准自发布以来，有效促进了银行间市场业务发展。然而，银行间市场新的业务场景和产品的不断推出以及银行间市场成员系统信息化程度的提高，迫切需要修订银行间市场相关标准。在JR/T 0065—2011基础上，本次修订银行间市场基础数据元，覆盖银行间市场交易前、中、后的业务场景和产品。



# 银行间市场基础数据元

## 1 范围

本标准规定了银行间市场业务活动中涉及到的数据元的标记、名称、说明及相关内容。本标准内容覆盖外汇市场、货币市场和衍生品市场的前、中、后台，以及债券市场的前、中台，不含债券市场的后台清算、结算部分。

本标准适用于银行间市场业务活动中涉及到的主要业务流程中的数据表达、交换、共享和应用。

## 2 规范性引用文件

下列文件对于本文件的应用是必不可少的。凡是注日期的引用文件，仅注日期的版本适用于本文件。凡是不注日期的引用文件，其最新版本（包括所有的修改单）适用于本文件。

GB 11714—1997 全国组织机构代码编制规则

GB/T 12406 表示货币和资金的代码

GB/T 16711—1996 银行业 银行电信报文 银行标识代码

GB/T 18391.5—2009 信息技术 元数据注册系统（MDR） 第5部分：命名和标识原则

GB/T 21076—2017 证券及相关金融工具 国际证券识别编码体系

GB 32100—2015 法人和其他组织统一社会信用代码编码规则

JR/T 0066 银行间市场业务数据交换协议

ISO 17442:2012 金融服务法人机构识别编码

## 3 术语和定义

GB/T 18391.1—2009界定的术语和定义适用于本文件。为了便于使用，以下重复列出了GB/T 18391.1—2009中的某些术语和定义。

### 3.1

#### 数据 data

信息的可再解释的形式化表示，以适用于通信、解释或处理。

注：数据可以由人工或自动的方式加工、处理。

[GB/T 18391.1—2009，定义3.2.6]

### 3.2

#### 数据元 data element

由一组属性规定其定义、标识、表示和允许值的数据单元。

[GB/T 18391.1—2009，定义3.3.8]

## 4 数据元的表示格式

每一个数据元均应通过下列表示格式进行描述：

- a) 数据元中文名称：数据元的中文名称，应按照GB/T 18391.5—2009中规定的数据元命名规范进行命名；
- b) 数据元英文名称：用英文表示的数据元名称；
- c) 数据元标识符：数据元在本标准中的唯一标识符，按照数据元的类目分组进行顺序编号，并适当留有一定的扩展空间；
- d) 说明：数据元含义的文字描述；
- e) 数据类型：用于定义数据域的取值类型，本标准由文本、数值、日期和时间四个基本的数据类型组成；
- f) 取值：取值范围可以是一个集合，任何在此集合外的取值都被认为是非法取值，取值若为“无”，则表示本标准中该数据元的取值无限制；
- g) IMIX 域名：JR/T 0066中基本的数据元素，每个域有其域号、业务含义和确定的取值范围。

## 5 数据元的类目分组

为了便于管理和使用数据元，本标准将数据元分为：

- 参与方：与机构、用户等有关的数据元；
- 产品：与市场、产品有关的数据元；
- 事件：与交易、交易后相关的数据元；
- 公共数据：与交易工具（包括货币、货币对、债券、资产支持证券等）有关的数据元；
- 条件：与交易时间段、节假日、起息日等有关的数据元；
- 风险控制：与限额、授信等有关的数据元。

## 6 数据元目录

### 6.1 参与方

#### 6.1.1 统一社会信用代码

中文名称：统一社会信用代码

英文名称：Unified Social Credit Identifier

标识符：1218

说明：按照GB 32100—2015规定，赋予每一个法人和其他组织在全国范围内唯一的，终身不变的18位法定身份识别码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，统一社会信用代码则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.2 法人机构识别编码

中文名称：法人机构识别编码

英文名称：Legal Entity Identifier



标识符：1217

说明：法人机构识别编码是按照ISO 17442:2012规定，为法人机构分配的由20位数字和字母组成的唯一编码，可用于标识参与国际金融交易的法人机构，简称LEI编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，法人机构识别编码则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.3 21位机构代码

中文名称：21位机构代码

英文名称：CFETS Institution Code

标识符：0506

说明：中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心给会员机构编制的21位编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartyID或者PartyDetailID或者NestedPartyID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，21位机构代码以“Party”组件中的ID域表示）

### 6.1.4 组织机构代码

中文名称：组织机构代码

英文名称：Organization Code

标识符：1220

说明：按照GB 11714—1997规定，赋予每一个组织在全国范围内唯一的，始终不变的9位识别标识码，已被整合到统一社会信用代码中，作为统一社会信用代码的第9位至第17位主体标识码，该代码在系统中仍使用，暂且保留，并建立与统一社会信用代码的映射关系。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartyID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，组织机构代码以“Party”组件中的ID域表示）

### 6.1.5 机构中文全称

中文名称：机构中文全称

英文名称：Institution Chinese Full Name

标识符：0507

说明：会员机构的中文全称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者NestedPartySubID或者LegPartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，机构中文全称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.6 机构英文全称

中文名称：机构英文全称

英文名称: Institution English Full Name

标识符: 0508

说明: 会员机构的英文全称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID或者NestedPartySubID或者LegPartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体,以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息,机构英文全称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.7 机构中文简称

中文名称: 机构中文简称

英文名称: Institution Chinese Short Name

标识符: 0509

说明: 会员机构的中文简称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID或者NestedPartySubID或者LegPartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体,以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息,机构中文简称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.8 机构英文简称

中文名称: 机构英文简称

英文名称: Institution English Short Name

标识符: 0510

说明: 会员机构的英文简称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID或者NestedPartySubID或者LegPartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体,以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息,机构英文简称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.9 清算币种

中文名称: 清算币种

英文名称: Clearing Currency

标识符: 0553

说明: 按照GB/T 12406规定,交易双方进行清算或交割时约定使用的清算货币代码。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: LegSettlCurrency 或者 AccountCurrency 或者 SettlCurrency 或者 Currency 或者 LegCurrency 或者 NDFCurrency

#### 6.1.10 是否清算行清算

中文名称: 是否清算行清算

英文名称：Clearing Mode Flag

标识符：0554

说明：会员机构是否通过清算机构进行清算。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：无

#### 6.1.11 清算行

中文名称：清算行

英文名称：Clearing Bank

标识符：0555

说明：会员机构的清算银行（代理行）名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者SettlPartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，清算行由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.12 托管账户名称

中文名称：托管账户名称

英文名称：Deposit Account Name

标识符：0567

说明：会员机构在托管机构所开立的账户的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者SettlPartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，托管账户名称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.13 托管账号

中文名称：托管账号

英文名称：Deposit Account Number

标识符：0568

说明：会员机构在托管机构的编号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者SettlPartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，托管账号由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.14 托管机构名称

中文名称：托管机构名称

英文名称：Deposit Institution Name

标识符：0569

说明：中华人民共和国境内的金融机构或投资人托管债券的第三方机构的机构名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，托管机构名称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.15 用户密码

中文名称：用户密码

英文名称：User Password

标识符：0585

说明：用户的系统登录密码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Password或者NewPassword

#### 6.1.16 成员类型

中文名称：成员类型

英文名称：Member Type

标识符：0511

说明：会员机构所属的机构类型。

数据类型：文本

取值：保险公司、保险公司的保险产品、保险公司的资产管理公司、财务公司、城市商业银行、城市信用社、村镇银行、调剂中心、股份制商业银行、国有商业银行、公募基金、基金公司、基金公司的特定客户资产管理业务、金融租赁公司、境外银行、农村商业银行、农村合作银行、农村信用联社、其他、其他投资产品、企业集团、企业年金、汽车金融公司、融资中心、社保基金、投资公司、外资银行、信托公司的金融产品、信托投资公司、证券公司、证券公司及子公司资产管理产品、政策性银行、中国人民银行、资产管理公司、中国邮政储蓄银行、虚拟票据发行人、境外保险公司、人民币合格境外机构投资者、企业、境外其他资产管理机构产品、境外央行、境外银行（国际）、境外证券公司、境外政府机构、银行表外理财、民营银行、农村商业银行和农村合作银行分账核算单元（国际）、期货公司、期货公司及子公司资产管理产品、其他分账核算单元（国际）、区内其他（国际）、区内银行（国际）、城市商业银行分账核算单元（国际）、中资大型商业银行、中资大型商业银行分账核算单元（国际）、非金融机构、非入市法人机构、股份制商业银行分账核算单元（国际）、合格境外机构投资者、基金公司的资产管理公司、境外保险公司非法人产品、境外保险公司（国际）、境外地方政府、境外基金管理公司非法人产品、境外其他（国际）、境外其他机构、私募基金、外资银行分账核算单元（国际）、未入市主机构、政策性银行分账核算单元（国际）、保险资产管理公司的资产管理产品、中资中型银行、中资小型银行、信托公司资产管理产品、基金管理公司及子公司专户产品

IMIX 域名：无

#### 6.1.17 成员大类

中文名称：成员大类

英文名称：Member Grand Type

标识符：0512

说明：会员机构在平台中所属的大类名称。

数据类型：文本

取值：中资大型银行、中资中型银行、中资小型银行、农村信用合作社、中资财务公司、外资金融机构、银行业非存款类金融机构、非银行金融机构、非金融企业

IMIX 域名：无

#### 6.1.18 中外资类别

中文名称：中外资类别

英文名称：Capital Type

标识符：0513

说明：会员机构的注册资本类型。

数据类型：文本

取值：中资、外资或合资

IMIX 域名：无

#### 6.1.19 法人代表

中文名称：法人代表

英文名称：Representative Name

标识符：0518

说明：会员机构的法定代表人指定的代表企业法人行为的自然人。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者ContactInfoID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，法人代表则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示；或者以“Party”下的子组件“ContactInfoGrp”表示机构用户联系方式详细信息，法人代表则由“ContactInfoGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.20 机构状态

中文名称：机构状态

英文名称：Institution Status

标识符：0520

说明：会员机构在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、禁用、待审核、审核失败、审核中、编辑中、改制禁用、非活动

IMIX 域名：无

#### 6.1.21 终止日

中文名称：终止日

英文名称：End Date

标识符：0522

说明：特定业务、数据或功能在系统中不可用的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名: 无

#### 6.1.22 USBKEY 证书代码

中文名称: USBKEY证书代码

英文名称: USBKEY Certificate Code

标识符: 0525

说明: USBKEY证书代码是USBKEY唯一的编码。USBKEY是一种USB接口的硬件设备, 内置单片机或智能卡芯片, 有一定的存储空间, 可存储用户的私钥以及数字证书, 利用USBKEY内置的公钥算法实现对用户身份的认证。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: ApplUniqueKey

#### 6.1.23 业务类型

中文名称: 业务类型

英文名称: Business Type

标识符: 0527

说明: 依据一定维度对业务的划分, 包括本币、外汇、信息、增值、其他。

数据类型: 文本

取值: 本币、外汇、信息、增值、其他

IMIX 域名: 无

#### 6.1.24 联系人姓名

中文名称: 联系人姓名

英文名称: Contact Person Name

标识符: 0528

说明: 会员机构联系人的姓名。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID或者ContactInfoID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体, 以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息, 联系人姓名则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示; 或者以“Party”下的子组件“ContactInfoGrp”表示机构用户联系方式详细信息, 联系人姓名则由“ContactInfoGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.25 部门

中文名称: 部门

英文名称: Department

标识符: 0529

说明: 会员机构联系人所在的部门名称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体, 以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息, 部门则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

### 6.1.26 部门地址

中文名称：部门地址

英文名称：Department Address

标识符：0530

说明：会员机构联系人所在部门的联系地址。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，部门地址则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.27 联系人类型

中文名称：联系人类型

英文名称：Contact Person Type

标识符：0532

说明：会员机构联系人在系统中的分类。

数据类型：文本

取值：交易机构要素（本币）、交易机构要素（外汇）、清算属性和账户（外汇）、发行人、机构技术信息、运行部场务支持、机构要素（CSTP用户-本币）、交易机构要素（贵金属）、交易机构要素（外币拆借）

IMIX 域名：无

注：CSTP为数据直通式处理系统。

### 6.1.28 联系人属性

中文名称：联系人属性

英文名称：Contact Person Attribute

标识符：0533

说明：一个联系人可有多个联系人属性，但前提是该机构拥有多个机构身份，且在多个机构身份下都维护了这个联系人。

数据类型：文本

取值：本币、CSTP用户-本币、外汇、发行人、清算、技术、网络、贵金属

IMIX 域名：无

### 6.1.29 机构身份名称

中文名称：机构身份名称

英文名称：Identity of Institution

标识符：0534

说明：会员机构在银行间市场上的身份名称。

数据类型：文本

取值：交易会员、交易后会员、信息会员、CSTP会员

IMIX 域名：无

### 6.1.30 机构身份状态

中文名称：机构身份状态

英文名称：Identity Status of Institution

标识符：0536

说明：用于标识机构身份在系统内所处的状态，决定机构身份是否可使用。

数据类型：文本

取值：活动、禁用、待审核、审核失败、审核中、编辑中、非活动

IMIX 域名：无

#### 6.1.31 退市日期

中文名称：退市日期

英文名称：Quit Date

标识符：0537

说明：会员机构退出银行间市场的日期，即在系统中机构身份状态变为禁用的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.32 退市原因

中文名称：退市原因

英文名称：Quit Reason

标识符：0538

说明：会员机构退出银行间市场的原因。

数据类型：文本

取值：退市、合并、更名、其他

IMIX 域名：无

#### 6.1.33 退市备注

中文名称：退市备注

英文名称：Quit Remark

标识符：0539

说明：会员机构退出银行间市场的其他情况说明。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.34 成立日期

中文名称：成立日期

英文名称：Establish Date

标识符：0541

说明：会员机构或发行人注册成立的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无



### 6.1.35 是否上市

中文名称：是否上市

英文名称：Listed Company Flag

标识符：0542

说明：会员机构或发行机构是否是上市公司。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：无

### 6.1.36 发行人状态

中文名称：发行人状态

英文名称：Issuer Status

标识符：0543

说明：发行人在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、禁用、待审核、审核失败、审核中、编辑中、非活动

IMIX 域名：无

### 6.1.37 是否结算代理行

中文名称：是否结算代理行

英文名称：Settlement Bank Flag

标识符：0546

说明：用于标识金融机构是否为结算代理行。结算代理行是根据与参与者签订的结算服务协议，负责对清算结果进行结算的银行业金融机构。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：无

### 6.1.38 交易账户代码

中文名称：交易账户代码

英文名称：Trading Account Code

标识符：1223

说明：机构交易账户在系统中的唯一编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.1.39 交易账户名称

中文名称：交易账户名称

英文名称：Trading Account Name

标识符：1224

说明：机构交易账户在系统中的名称。

数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.1.40 交易账户状态

中文名称：交易账户状态  
英文名称：Trading Account Status  
标识符：0549  
说明：机构交易账户在系统中所处的状态。  
数据类型：文本  
取值：活动、禁用、待审核、审核失败、审核中、编辑中、非活动  
IMIX 域名：无

#### 6.1.41 清算账户代码

中文名称：清算账户代码  
英文名称：Clearing Account Code  
标识符：1225  
说明：机构清算账户在系统中的唯一编码。  
数据类型：文本  
取值：无

IMIX 域名：SettlPartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，清算账户代码则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.42 清算账户名称

中文名称：清算账户名称  
英文名称：Clearing Account Name  
标识符：1226  
说明：会员机构进行资金清算的账户名称。  
数据类型：文本  
取值：无

IMIX 域名：SettlPartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，清算账户名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.1.43 清算账户状态

中文名称：清算账户状态  
英文名称：Clearing Account Status  
标识符：0552  
说明：机构清算账户在系统中所处的状态。  
数据类型：文本  
取值：活动、禁用、待审核、审核失败、审核中、编辑中、非活动  
IMIX 域名：无

#### 6.1.44 账户名称

中文名称：账户名称

英文名称：Account Name

标识符：0557

说明：会员机构在清算银行（代理行）的账户名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，账户名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.45 发起行行号

中文名称：发起行行号

英文名称：Initiator Bank Code

标识符：0560

说明：发起行在中国人民银行大额实时支付系统中的开户行行号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.46 会员当地人行账号

中文名称：会员当地人行账号

英文名称：Local PBOC Account Number

标识符：0561

说明：会员机构在当地中国人民银行所开立的账户的账号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.47 清算行支付系统行号

中文名称：清算行支付系统行号

英文名称：Clearing Bank Payment System Code

标识符：0562

说明：会员机构的清算银行（代理行）在中国人民银行大额实时支付系统的开户行行号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，清算行支付系统行号则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.48 支付系统行号

中文名称：支付系统行号

英文名称：Payment System Code

标识符：0563

说明：会员机构在中国人民银行大额实时支付系统中的开户行行号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，支付系统行号则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.49 资金开户行名称

中文名称：资金开户行名称

英文名称：Capital Bank Name

标识符：0564

说明：会员机构用于资金结算的账户的开户行名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，资金开户行名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.50 资金账号

中文名称：资金账号

英文名称：Capital Account Number

标识符：0565

说明：会员机构用于资金结算的账户的账号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，资金账号则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.51 资金账户名称

中文名称：资金账户名称

英文名称：Capital Account Name

标识符：0566

说明：会员机构用于资金结算的账户的户名。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，资金账户名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.52 业务关系类型

中文名称：业务关系类型

英文名称：Business Relationship Type

标识符：0574

说明：会员机构之间的所属业务关系在系统中的分类。

数据类型：文本

取值：总-分行、基金管理公司-基金、基金托管行-基金、基金管理公司-年金、保险公司-保险产品、信托公司-信托产品、保险公司-年金、证券公司-年金、证券公司-社保基金、资产管理公司-保险、基金公司-专项资产、CSTP用户-关联机构、证券公司-资产管理业务、集合票据发行体-联合发行人、集合债券发行体-联合发行人、结算代理行-境外参加行、代理机构-委托机构

IMIX 域名：无

#### 6.1.53 操作关系类型

中文名称：操作关系类型

英文名称：Operation Relationship Type

标识符：0575

说明：一家机构可对另一家或多家机构进行操作的类型。

数据类型：文本

取值：限额设置、限额共享、委托交易、成交查询、交易控制

IMIX 域名：无

#### 6.1.54 主机构

中文名称：主机构

英文名称：Master Institution

标识符：0576

说明：机构关系中的主导机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述主机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述主机构实体详细信息，主机构名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.55 关联机构

中文名称：关联机构

英文名称：Relevant Institution

标识符：0577

说明：机构关系中的从属机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.56 权限名称

中文名称：权限名称

英文名称：Authority Name

标识符：0578

说明：权限在系统中的名称，如Trading权限、Contribution权限、Trading Model权限、特殊币种参考价报价权限等。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.57 权限类型

中文名称：权限类型

英文名称：Authority Type

标识符：1209

说明：系统针对不同权限所做的分类。

数据类型：文本

取值：业务权限、功能权限、数据权限

IMIX 域名：无

#### 6.1.58 权限状态

中文名称：权限状态

英文名称：Authority Status

标识符：0579

说明：会员机构及其用户的权限在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.59 机构权限终止日

中文名称：机构权限终止日

英文名称：Authority End Date

标识符：0580

说明：会员机构权限在系统中失效的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.60 机构角色类型

中文名称：机构角色类型

英文名称：Institution Role Type

标识符：0581

说明：会员机构在银行间市场上进行交易的角色类型。

数据类型：文本

取值：贵金属（GOLDR）、本币（CNYR）、外汇（FXR）

IMIX 域名：无

#### 6.1.61 机构角色中文名称

中文名称：机构角色中文名称

英文名称：Institution Role Chinese Name

标识符：1222

说明：会员机构的机构角色中文名称。

数据类型：文本

取值：根据机构角色类型划分：

- a) 贵金属：贵金属询价尝试做市机构、贵金属询价普通会员、贵金属询价做市商；
- b) 本币：会员、非会员、做市商、尝试做市业务金融机构；
- c) 外汇：人民币对瑞郎直接交易做市商、人民币对兰特直接交易做市商、人民币对韩元直接交易做市商、综合做市商、人民币对瑞典克朗直接交易做市商、人民币对挪威克朗直接交易做市商、人民币对土耳其里拉直接交易做市商、人民币对墨西哥比索直接交易做市商、人民币对匈牙利福林直接交易做市商、人民币对波兰兹罗提直接交易做市商、人民币对丹麦克朗直接交易做市商、人民币对加元直接交易做市商、人民币对日元直接交易做市商、人民币对澳元直接交易做市商、人民币对迪拉姆直接交易做市商、人民币对里亚尔直接交易做市商、人民币对新西兰直接交易做市商、人民币对新加坡直接交易做市商、人民币对英镑直接交易做市商、人民币对欧元直接交易做市商、即期结售汇做市商、即期结售汇尝试做市机构、即期结售汇普通会员、远掉结售汇做市商、远掉结售汇尝试做市机构、远掉结售汇普通会员、卢布做市商、林吉特做市商、外币对做市商、外币对会员、期权结售汇会员、泰铢报价行、泰铢参与行、坚戈报价行、坚戈参与行、越南盾报价行、越南盾参与行。

IMIX 域名：PartyRole

#### 6.1.62 用户姓名

中文名称：用户姓名

英文名称：User Name

标识符：0183

说明：用户在系统中的姓名。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Username

#### 6.1.63 用户身份证号码

中文名称：用户身份证号码

英文名称：User ID Number

标识符：0582

说明：用户的身份证号码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，用户身份证号码则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.64 用户状态

中文名称：用户状态

英文名称：User Status

标识符：0584

说明：用户在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、锁定、未激活、禁用、重设

IMIX 域名：无

#### 6.1.65 用户地址

中文名称：用户地址

英文名称：User Address

标识符：0586

说明：用户的地址信息。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID或者ContactInfoID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，用户地址则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示；或者以“Party”下的子组件“ContactInfoGrp”描述机构用户联系方式详细信息，用户地址则由“ContactInfoGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.66 角色名称

中文名称：角色名称

英文名称：Role Name

标识符：0588

说明：用户角色在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.67 角色状态

中文名称：角色状态

英文名称：Role Status

标识符：0589

说明：用户角色在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、禁用

IMIX 域名：无

#### 6.1.68 基金净值总额

中文名称：基金净值总额

英文名称：Fund Total Net Amount

标识符：0310

说明：基金公司的用户向中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心提交本机构的基金净值。基金净值总额的计算公式为：基金净值总额=基金资产总额-基金负债总额及各项费用。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.69 接收用户



中文名称：接收用户  
英文名称：Feed User ID  
标识符：0591  
说明：会员机构中接收订阅信息的用户。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.1.70 接收密码

中文名称：接收密码  
英文名称：Feed Password  
标识符：0592  
说明：会员机构用户接收订阅信息时所用的密码。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.1.71 订阅连接方式

中文名称：订阅连接方式  
英文名称：Subscription Connection Mode  
标识符：0593  
说明：会员机构从中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统获取订阅信息的连接方法。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.1.72 最大连接数

中文名称：最大连接数  
英文名称：Max ConCurrent Connection  
标识符：0594  
说明：会员机构接入中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统获取订阅信息的最大用户数。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.1.73 应计额

中文名称：应计额  
英文名称：Accrued Amount  
标识符：0889  
说明：依照系统中设置的各项费率值计算得出的总费用。  
数据类型：数值  
取值：无

IMIX 域名: MiscFeeAmt或者NetMiscFeeAmt或者CommissionAmt或者NetCommissionAmt

#### 6.1.74 优惠金额

中文名称: 优惠金额

英文名称: Discount Amount

标识符: 0890

说明: 针对不同交易量、终端数等进行的优惠计算。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: CommissionPrimeAmt

#### 6.1.75 应缴额

中文名称: 应缴额

英文名称: Payable Amount

标识符: 0891

说明: 扣除优惠金额后, 会员机构实际应缴的金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: NetCommissionAmt

#### 6.1.76 计费日期

中文名称: 计费日期

英文名称: Fee Calculate Date

标识符: 0892

说明: 计算会员机构不同类型费用的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.1.77 成交日期

中文名称: 成交日期

英文名称: Transaction Date

标识符: 0335

说明: 一笔交易达成成交时的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: TradeDate

#### 6.1.78 累积优惠

中文名称: 累积优惠

英文名称: Accumulative Discount

标识符: 0893

说明: 依照不同优惠费率、特殊费率计算出的累积优惠金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.79 千元封顶优惠

中文名称：千元封顶优惠

英文名称：Cap Discount of One Thousand Yuan

标识符：0894

说明：一笔交易手续费超过1000元时按1000元进行收取。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.80 交易终端数量

中文名称：交易终端数量

英文名称：Number of Transaction Terminals

标识符：0895

说明：普通会员机构接入中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统的终端数目。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.81 做市商终端数量

中文名称：做市商终端数量

英文名称：Number of Market Maker Terminals

标识符：0896

说明：做市商机构接入中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统的终端数目。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.82 交易终端费用

中文名称：交易终端费用

英文名称：Transaction Terminals Fee

标识符：0897

说明：计费周期内会员机构接入中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统的终端费用。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.83 做市商终端费用

中文名称：做市商终端费用

英文名称：Market Maker Terminals Fee

标识符：0898

说明：计费周期内做市商机构接入中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心系统的终端费用。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.84 浮动终端费用

中文名称：浮动终端费用

英文名称：Floating Terminals Fee

标识符：0899

说明：在该年预收终端费已经存在的前提下，当某会员该年的终端数发生变化或者某会员该年的做市商身份发生改变时，计算出的需补缴或退费的终端费（正数表示要补缴，负数表示要退费），即为浮动终端费用。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.85 发行机构

中文名称：发行机构

英文名称：Issuer

标识符：0913

说明：发行人在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Issuer或者UnderlyingIssuer

#### 6.1.86 用户 ID

中文名称：用户 ID

英文名称：User ID

标识符：1115

说明：用户登录系统的唯一ID。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Username

#### 6.1.87 发行人编号

中文名称：发行人编号

英文名称：Issuer Number

标识符：1116

说明：发行人在系统内的编号。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.1.88 中间行名称

中文名称：中间行名称

英文名称：Intermediary Bank Name

标识符：1117

说明：资金结算、划拨或周转的中间金融机构的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，中间行名称则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.89 中间行账号

中文名称：中间行账号

英文名称：Intermediary Bank Account

标识符：1118

说明：参与方在中间金融机构的账号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，中间行账号则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.90 资金开户行 BIC Code

中文名称：资金开户行BIC Code

英文名称：Capital Bank BIC Code

标识符：1119

说明：即资金开户行的银行识别代码。银行识别代码（BIC）是按照GB/T 16711—1996规定，由一连串八位或十一位字符构成，用于在SWIFT电文中区分金融交易中的不同金融机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，资金开户行BIC Code则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

### 6.1.91 中间行 BIC Code

中文名称：中间行BIC Code

英文名称：Intermediary Bank BIC Code

标识符：1120

说明：即中间行的银行识别代码。银行识别代码（BIC）是按照GB/T 16711—1996规定，由一连串八位或十一位字符构成，用于在SWIFT电文中区分金融交易中的不同金融机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，中间行BIC Code则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.92 收款行 BIC Code

中文名称：收款行BIC Code

英文名称：Beneficiary Bank BIC Code

标识符：1121

说明：即收款行的银行识别代码。银行识别代码（BIC）是按照GB/T 16711—1996规定，由一连串八位或十一位字符构成，用于在SWIFT电文中区分金融交易中的不同金融机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，收款行BIC Code则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.93 用户类型

中文名称：用户类型

英文名称：User Type

标识符：1127

说明：用户类型包括中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心场务用户、机构非交易员用户和机构交易员用户。

数据类型：文本

取值：中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心场务用户、机构非交易员用户、机构交易员用户

IMIX 域名：无

#### 6.1.94 交易员 ID

中文名称：交易员ID

英文名称：Trader ID

标识符：1138

说明：会员机构的交易员在系统中的唯一ID。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，交易员ID则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.1.95 行权用户代码

中文名称：行权用户代码

英文名称：Exercise User Code

标识符：1143

说明：行权用户登录系统的唯一代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.1.96 证书密码

中文名称：证书密码  
 英文名称：Certificate Password  
 标识符：1157  
 说明：会员机构安全证书的密码。  
 数据类型：文本  
 取值：无  
 IMIX 域名：无

### 6.1.97 发行人账号

中文名称：发行人账号  
 英文名称：Issuer Account  
 标识符：1167  
 说明：用于描述当发行途径为“中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心发行”时，填写的中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心的相关账号信息。  
 数据类型：文本  
 取值：无  
 IMIX 域名：PartyDetailAltSubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，发行人账号则由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

## 6.2 产品

### 6.2.1 市场名称

中文名称：市场名称  
 英文名称：Market Name  
 标识符：0595  
 说明：市场的名称。  
 数据类型：文本  
 取值：债券市场、货币市场、衍生品市场、外汇市场  
 IMIX 域名：无

### 6.2.2 交易产品名称

中文名称：交易产品名称  
 英文名称：Product Name  
 标识符：0596  
 说明：交易产品的名称。  
 数据类型：文本  
 取值：现券买卖、债券借贷、质押式回购、买断式回购、人民币拆借、外汇即期、债券远期、利率互换-固浮互换、利率互换-基准互换、远期利率协议、信用风险缓释凭证、期差合约、Delta即期头寸交换、Delta远期头寸交换、外汇远期、外汇掉期、外汇货币掉期、外汇期权、预发行、外币拆借  
 IMIX 域名：SecurityType或者MarketIndicator

### 6.2.3 交易产品代码

中文名称：交易产品代码

英文名称：Product Code

标识符：0597

说明：新增交易产品时系统生成的唯一编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID或者LegSecurityID或者UnderlyingSecurityID

#### 6.2.4 标准产品名称

中文名称：标准产品名称

英文名称：Standardized Product Name

标识符：0598

说明：标准产品的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Symbol

#### 6.2.5 标准产品代码

中文名称：标准产品代码

英文名称：Standardized Product Code

标识符：0035

说明：新增标准产品时系统生成的唯一编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID或者LegSecurityID或者UnderlyingSecurityID

#### 6.2.6 最高成交价格

中文名称：最高成交价格

英文名称：Highest Price

标识符：0599

说明：交易平台中某产品在一定交易时段内交易达成的最高价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高成交价格）

#### 6.2.7 最低成交价格

中文名称：最低成交价格

英文名称：Lowest Price

标识符：0600

说明：交易平台中某产品在一定交易时段内交易达成的最低价格。

数据类型：数值

取值：无



IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件的Type域和Px域组合表示最低成交价格)

#### 6.2.8 开盘成交价格

中文名称: 开盘成交价格

英文名称: Opening Price

标识符: 0601

说明: 交易平台中某产品在开盘时第一笔交易达成的价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示盘成交价格)

#### 6.2.9 最新成交价格

中文名称: 最新成交价格

英文名称: Latest Price

标识符: 0602

说明: 交易平台中某产品最新一笔交易达成的价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”中的Type域和Px域组合表示最新成交价格)

#### 6.2.10 前收盘价格

中文名称: 前收盘价格

英文名称: Previous Closing Price

标识符: 0603

说明: 交易平台中某产品前一交易日最后一笔交易达成的价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘价格)

#### 6.2.11 加权价

中文名称: 加权价

英文名称: Weighted Price

标识符: 0604

说明: 在特定时间段内, 每笔成交价格与成交量的乘积之和除以成交量之和所得出的价格。对于债券交易, 成交量指券面总额; 对于回购和拆借交易, 成交量指成交金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.12 前加权平均价格

中文名称：前加权平均价格

英文名称：Previous Weighted Average Price

标识符：0605

说明：前一交易日的成交价格加权平均。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均价格）

#### 6.2.13 加权平均价格

中文名称：加权平均价格

英文名称：Weighted Average Price

标识符：0606

说明：某一时段内的成交价格加权平均。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均价格）

#### 6.2.14 涨跌点数

中文名称：涨跌点数

英文名称：Price Change Point

标识符：0607

说明：某一交易品种最新价与前一交易日收盘价格或当日开盘成交价格之间的差额。

具体公式有如下两种：

a) 本币：涨跌点数=最新成交价格-前收盘价格；

b) 外汇：涨跌点数=最新成交价格-开盘成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示涨跌点数）

#### 6.2.15 涨跌幅

中文名称：涨跌幅

英文名称：Price Change Ratio

标识符：0608

说明：某一交易品种涨跌与前一交易日收盘价格或当日开盘成交价格之间的百分比。

具体公式有如下两种：

a) 本币：涨跌幅=（最新成交价格-前收盘价格）÷前收盘价格×100%；

b) 外汇：涨跌幅=（最新成交价格-开盘成交价格）÷开盘成交价格×100%。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示涨跌幅）

#### 6.2.16 收盘成交价格

中文名称：收盘成交价格

英文名称：Closing Price

标识符：0610

说明：交易平台中某产品在收盘时最后一笔交易达成的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘成交价格）

#### 6.2.17 最新拆借利率

中文名称：最新拆借利率

英文名称：Latest Offered Rate

标识符：0611

说明：特指同业拆借产品的最新成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新拆借利率）

#### 6.2.18 开盘拆借利率

中文名称：开盘拆借利率

英文名称：Opening Offered Rate

标识符：0612

说明：特指同业拆借产品的开盘成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘拆借利率）

#### 6.2.19 收盘拆借利率

中文名称：收盘拆借利率

英文名称：Closing Offered Rate

标识符：0613

说明：特指同业拆借产品的收盘成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘拆借利率）

#### 6.2.20 加权平均拆借利率

中文名称：加权平均拆借利率

英文名称：Weighted Average Offered Rate

标识符：0614

说明：特指同业拆借产品的加权平均价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均拆借利率）

#### 6.2.21 前收盘拆借利率

中文名称：前收盘拆借利率

英文名称：Previous Closing Offered Rate

标识符：0615

说明：特指同业拆借产品的前收盘价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘拆借利率）

#### 6.2.22 前加权平均拆借利率

中文名称：前加权平均拆借利率

英文名称：Previous Weighted Average Offered Rate

标识符：0616

说明：特指同业拆借产品的前加权平均价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均拆借利率）

#### 6.2.23 最高拆借利率

中文名称：最高拆借利率

英文名称：Highest Offered Rate

标识符：0617

说明：特指同业拆借产品的最高成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高拆借利率）

#### 6.2.24 最低拆借利率

中文名称：最低拆借利率

英文名称: Lowest Offered Rate

标识符: 0618

说明: 特指同业拆借产品的最低成交价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低拆借利率)

#### 6.2.25 最新回购利率

中文名称: 最新回购利率

英文名称: Latest Repo Rate

标识符: 0619

说明: 特指回购市场产品的最新成交价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新回购利率)

#### 6.2.26 开盘回购利率

中文名称: 开盘回购利率

英文名称: Opening Repo Rate

标识符: 0620

说明: 特指回购市场产品的开盘成交价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘回购利率)

#### 6.2.27 收盘回购利率

中文名称: 收盘回购利率

英文名称: Closing Repo Rate

标识符: 0621

说明: 特指回购市场产品的收盘成交价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘回购利率)

#### 6.2.28 加权平均回购利率

中文名称: 加权平均回购利率

英文名称: Weighted Average Repo Rate

标识符: 0622

说明: 特指回购市场产品的加权平均价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均回购利率）

#### 6.2.29 前收盘回购利率

中文名称：前收盘回购利率

英文名称：Previous Closing Repo Rate

标识符：0623

说明：特指回购市场产品的前收盘价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘回购利率）

#### 6.2.30 前加权平均回购利率

中文名称：前加权平均回购利率

英文名称：Previous Weighted Average Repo Rate

标识符：0624

说明：特指回购市场产品的前加权平均价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均回购利率）

#### 6.2.31 最高回购利率

中文名称：最高回购利率

英文名称：Highest Repo Rate

标识符：0625

说明：特指回购市场产品的最高成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高回购利率）

#### 6.2.32 最低回购利率

中文名称：最低回购利率

英文名称：Lowest Repo Rate

标识符：0626

说明：特指回购市场产品的最低成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低回购利率)

### 6.2.33 最新净价

中文名称: 最新净价

英文名称: Latest Net Price

标识符: 0076

说明: 当日该债券最新一笔交易的净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新净价)

### 6.2.34 最新收益率

中文名称: 最新收益率

英文名称: Latest Yield

标识符: 0079

说明: 当日该债券最新一笔交易的收益率。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新收益率)

### 6.2.35 最高净价

中文名称: 最高净价

英文名称: Highest Net Price

标识符: 0021

说明: 当日一定交易时段内债券交易达成的最高净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高净价)

### 6.2.36 最低净价

中文名称: 最低净价

英文名称: Lowest Net Price

标识符: 0092

说明: 当日一定交易时段内债券交易达成的最低净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低净价)

#### 6.2.37 前加权平均净价

中文名称：前加权平均净价

英文名称：Previous Weighted Average Net Price

标识符：0627

说明：前一交易日债券交易的加权平均净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均净价）

#### 6.2.38 前加权平均收益率

中文名称：前加权平均收益率

英文名称：Previous Weighted Average Yield

标识符：0250

说明：前一交易日债券交易的加权平均收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均收益率）

#### 6.2.39 前收盘利率

中文名称：前收盘利率

英文名称：Previous Closing Rate

标识符：0628

说明：前一交易日的收盘成交利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘利率）

#### 6.2.40 前加权平均利率

中文名称：前加权平均利率

英文名称：Previous Weighted Average Rate

标识符：0629

说明：前一交易日的加权平均利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均利率）

#### 6.2.41 开盘固定利率

中文名称：开盘固定利率



英文名称：Opening Fixing Rate

标识符：0630

说明：特指远期利率协议产品和利率互换产品的开盘成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘固定利率）

#### 6.2.42 最新固定利率

中文名称：最新固定利率

英文名称：Latest Fixing Rate

标识符：0631

说明：特指远期利率协议产品和利率互换产品的最新成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新远期固定利率）

#### 6.2.43 收盘固定利率

中文名称：收盘固定利率

英文名称：Closing Fixing Rate

标识符：0052

说明：特指远期利率协议产品和利率互换产品的收盘成交价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘固定利率）

#### 6.2.44 加权平均固定利率

中文名称：加权平均固定利率

英文名称：Weighted Average Fixing Rate

标识符：0632

说明：特指远期利率协议产品和利率互换产品的加权平均价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均固定利率）

#### 6.2.45 买报价

中文名称：买报价

英文名称：Bid Quote Price

标识符：0633

说明：买方向的报价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx或者YieldPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示买报价，或者以“Curve”组件中的Type域和Px域组合表示买报价）

#### 6.2.46 卖报价

中文名称：卖报价

英文名称：Ask Quote Price

标识符：0634

说明：卖方向的报价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx或者YieldPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示卖报价，或者以“Curve”组件中的Type域和Px域组合表示卖报价）

#### 6.2.47 参考价名称

中文名称：参考价名称

英文名称：Reference Price Name

标识符：0609

说明：参考价的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkCurveName或者LegBenchmarkCurveName

#### 6.2.48 参考价数值

中文名称：参考价数值

英文名称：Reference Price Value

标识符：0639

说明：参考价的取值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice或者NestedBenchmarkPrice

#### 6.2.49 回购利率

中文名称：回购利率

英文名称：Repo Rate

标识符：0394

说明：根据首期资金支付额和到期资金支付额计算出的利率，为借入资金所付出的额外金额年化后的年利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Price或者LegPrice或者LastPx

### 6.2.50 拆借利率

中文名称：拆借利率  
英文名称：Offered Rate  
标识符：0359  
说明：金融机构之间相互融通短期资金的利率。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：Price或者LegPrice或者LastPx

### 6.2.51 清算方式名称

中文名称：清算方式名称  
英文名称：Clearing Method Name  
标识符：0640  
说明：清算方式的名称。  
数据类型：文本  
取值：中央对手方清算、双边清算、净额清算  
IMIX 域名：ClearingMethod或者LegClearingMethod

### 6.2.52 清算速度

中文名称：清算速度  
英文名称：Clearing Speed  
标识符：0641  
说明：从达成交易到实际清算的时间间隔。  
数据类型：文本  
取值：T+0、T+1、T+2、T+3、T+4  
IMIX 域名：SettlType或者LegSettlType

### 6.2.53 交易方向

中文名称：交易方向  
英文名称：Direction  
标识符：0285  
说明：交易的方向。如：外汇即期的买入、卖出，质押式回购的正回购、逆回购等。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：Side或者LegSide

### 6.2.54 基准货币交易方向

中文名称：基准货币交易方向  
英文名称：Base Direction  
标识符：0642  
说明：基准货币的交易方向。  
数据类型：文本

取值：买入、卖出

IMIX 域名：Side或者LegSide

#### 6.2.55 非基准货币交易方向

中文名称：非基准货币交易方向

英文名称：Term Direction

标识符：0643

说明：非基准货币的交易方向。

数据类型：文本

取值：买入、卖出

IMIX 域名：Side或者LegSide

#### 6.2.56 计息基准

中文名称：计息基准

英文名称：Interest Basis

标识符：0644

说明：计算利息时计算天数的规则。

数据类型：文本

取值：A/A、A/365、A/365F、30/360、A/360、A/A-Bond

IMIX 域名：LegDayCount或者DayCount

#### 6.2.57 计息方式

中文名称：计息方式

英文名称：Interest Method

标识符：0179

说明：计算利息的方式。

数据类型：文本

取值：单利、复利

IMIX 域名：InterestAccrualMethod或者LegInterestAccrualMethod

#### 6.2.58 固定利率

中文名称：固定利率

英文名称：Fixed Interest Rate

标识符：0395

说明：约定的计算固定利率支付方应支付的固定金额所依据的利率水平，在借贷期内利率不作调整。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Price或者LegPrice或者LegLastPx

#### 6.2.59 计息天数调整

中文名称：计息天数调整

英文名称：Interest Days Adjustment

标识符：0646

说明：支付日调整后的计息天数调整规则。

数据类型：文本

取值：不调整、实际天数

IMIX 域名：InterestAccuralDaysAdjustment或者LegInterestAccuralDaysAdjustment

#### 6.2.60 利差

中文名称：利差

英文名称：Spreads

标识符：0214

说明：又称点差，在浮动利率基础上加、减的基点数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Spread或者LegBenchmarkSpread

#### 6.2.61 名义本金

中文名称：名义本金

英文名称：Notional Principal

标识符：0647

说明：交易双方在协议中所确定的合约规模，又称名义金额。利率互换、远期利率协议、信用风险缓释凭证等衍生品交易的名义本金金额，一般用来计算交易双方未来应收应付所依据的金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IOIQty或者LastQty或者OrderQty或者LegIOIQty或者LegOrderQty或者GrossTradeAmt

#### 6.2.62 期限

中文名称：期限

英文名称：Tenor/Period

标识符：0648

说明：交易所跨时间长度，或在计费系统进行计费时针对特定市场进行的期限划分。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：TradeLimitDays或者SettlType或者LegSettlType

#### 6.2.63 回购期限

中文名称：回购期限

英文名称：Repo Term

标识符：0447

说明：质押式回购、买断式回购中交易所跨的时间长度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：TradeLimitDays

#### 6.2.64 起息日

中文名称：起息日

英文名称：Value Date

标识符：0649

说明：开始计算资金利息的日期，或交易双方履行资金交割与结算的日期，在外汇市场，一般情况下，起息日与结算日（Settlement Date）、交割日（Delivery Date）相同。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ValueDate或者SettlDate或者StartDate或者LegSettlDate或者DeliveryDate

#### 6.2.65 首次利率确定日

中文名称：首次利率确定日

英文名称：First Fixing Date

标识符：0130

说明：交易中首次确定利率的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：LegInterestAccrualDate或者InterestFixDate或者InterestAccrualDate

#### 6.2.66 首期定期支付日

中文名称：首期定期支付日

英文名称：First Regular Payment Date

标识符：0129

说明：若存在前端残段，首期定期支付日为前端残段之后首个计息期的支付日；若不存在前端残段，首期定期支付日则为首个计息期的支付日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：LegCouponPaymentDate

#### 6.2.67 期初本金交换日

中文名称：期初本金交换日

英文名称：Beginning Principal Effective Date

标识符：0650

说明：又称首期起息日。指第一个付息周期或付息残段（外汇期权）的起息日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：IniExDate

#### 6.2.68 首期起息日

中文名称：首期起息日

英文名称：First Effective Date

标识符：0651

说明：首次进行利息计算的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：FirstPeriodStartDate或者SettlDate

### 6.2.69 支付日

中文名称：支付日

英文名称：Payment Date

标识符：0652

说明：交易一方进行支付的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CouponPaymentDate或者PaymentDate

### 6.2.70 支付日调整

中文名称：支付日调整

英文名称：Payment Date Adjustment

标识符：0653

说明：支付日遇到节假日的调整规则，适用营业日准则。

数据类型：文本

取值：上一营业日、下一营业日、经调整的下一营业日

IMIX 域名：CouponPaymentDateReset或者LegCouponPaymentDateReset或者SettlDateAdjustment

### 6.2.71 支付周期

中文名称：支付周期

英文名称：Payment Period

标识符：0654

说明：交易双方用以推算支付日的固定时间间隔，在推算支付日时，若支付周期为季、半年、年，则等同于三个月、六个月、十二个月。

数据类型：文本

取值：天、周、两周、月、季、半年、年、到期支付、期初支付

IMIX 域名：LegCouponPaymentFrequency或者CouponPaymentFrequency

### 6.2.72 重置频率

中文名称：重置频率

英文名称：Reset Frequency

标识符：0111

说明：以天、周、两周、月、季、半年、年为周期，来推算重置日，其中天指每个营业日。在计算重置日时，若重置频率为季、半年、年，则等同于三个月、六个月、十二个月。

数据类型：文本

取值：到期、天、周、两周、月、季、半年、年

IMIX 域名：LegInterestAccrualResetFrequency或者InterestAccrualResetFrequency

### 6.2.73 券面总额

中文名称：券面总额

英文名称: Nominal Volume

标识符: 0223

说明: 交易债券的总面额。券面总额的计算公式为: 券面总额=债券数量×单张债券面值。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: IOIQty或者LastQty或者OrderQty或者LegIOIQty或者LegOrderQty或者LegLastQty

#### 6.2.74 首期交易净价

中文名称: 首期交易净价

英文名称: 1st Net Price

标识符: 0655

说明: 首期结算时逆回购方对回购债券支付的债券净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: UnderlyingPx

#### 6.2.75 首期收益率

中文名称: 首期收益率

英文名称: 1st Yield

标识符: 0656

说明: 债券首次净价对应的到期收益率。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: StipulationValue或者LegStipulationValue或者UnderlyingStipValue (JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示首期收益率)

#### 6.2.76 首期应计利息

中文名称: 首期应计利息

英文名称: 1st Accrued Interest

标识符: 0657

说明: 首次结算时的每百元债券应计利息。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: UnderlyingAccruedInterestAmt

#### 6.2.77 到期交易净价

中文名称: 到期交易净价

英文名称: Net Price to Maturity

标识符: 0658

说明: 到期结算时正回购方对回购债券支付的债券净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: UnderlyingPx2



### 6.2.78 到期收益率

中文名称：到期收益率

英文名称：Yield to Maturity (YTM)

标识符：0440

说明：债券持有到全部付息结束后的回报率，以到期交易全价买入债券并持有至到期的收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：StipulationValue或者LegStipulationValue或者UnderlyingStipValue（JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示到期收益率）

### 6.2.79 到期应计利息

中文名称：到期应计利息

英文名称：Accrued Interest to Maturity

标识符：0659

说明：上次付息日（或起息日）至到期结算日为止（不含到期结算日）累积的按百元面值计算的债券发行人应付给债券持有人的利息。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingAccruedInterestAmt2

### 6.2.80 首期全价

中文名称：首期全价

英文名称：1st Dirty Price

标识符：0660

说明：首次结算时的净价与应计利息之和。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingDirtyPrice

### 6.2.81 首期资金结算额

中文名称：首期资金结算额

英文名称：1st Settlement Amount

标识符：0661

说明：在一笔交易中，指交易双方约定的逆回购方在首期结算日向正回购方支付的资金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：SettlCurrAmt或者LegSettlCurrAmt

### 6.2.82 结算方式名称

中文名称：结算方式名称

英文名称：Settlement Method Name

标识符：0662

说明：结算方式在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：根据交易产品不同，具体取值如下：

- a) 债券借贷，取值为：券费对付、券券对付、返券付费解券；
- b) 外汇期权，取值为：全额结算、差额结算；
- c) 其他产品，取值为：券款对付、见券付款、见款付券。

IMIX 域名：DeliveryTypeOption或者LegDeliveryType或者DeliveryType

#### 6.2.83 首期结算方式

中文名称：首期结算方式

英文名称：1st Settlement Method

标识符：0663

说明：首次结算时的券款清算/结算安排规则。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：DeliveryTypeOption或者LegDeliveryType或者DeliveryType

#### 6.2.84 到期结算方式

中文名称：到期结算方式

英文名称：Settlement Method to Maturity

标识符：0233

说明：到期结算时的券款清算/结算安排规则。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：DeliveryType2或者LegDeliveryType2

#### 6.2.85 到期全价

中文名称：到期全价

英文名称：All-in Price to Maturity

标识符：0664

说明：到期结算时的净价与应计利息之和。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：DirtyPrice2或者UnderlyingDirtyPrice2

#### 6.2.86 到期资金结算额

中文名称：到期资金结算额

英文名称：Capital Settlement Amount to Maturity

标识符：0665

说明：在一笔交易中，指交易双方约定的正回购方在到期结算日向逆回购方支付的资金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：SettlCurrAmt2或者LegSettlCurrAmt2

### 6.2.87 结算日

中文名称：结算日

英文名称：Settlement Date

标识符：0168

说明：又称交割日。由交易双方约定的交割资金的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate或者LegSettlDate或者DeliveryDate

### 6.2.88 首期结算日

中文名称：首期结算日

英文名称：1st Settlement Date

标识符：0666

说明：在回购交易中，交易双方约定的逆回购方将资金划至正回购方指定的资金账户，且正回购方在相关回购债券上完成质押登记或将相关回购债券转让给逆回购方的日期；在人民币拆借、外币拆借中，交易双方约定的拆出方将资金划至拆入方指定的资金账户的日期；在债券借贷产品中，交易双方约定的融入方将资金划至融出方指定的资金账户的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate

### 6.2.89 到期结算日

中文名称：到期结算日

英文名称：Settlement Date to Maturity

标识符：0226

说明：在一笔交易中，交易双方约定的正回购方将资金划至逆回购方指定的资金账户，且逆回购方解除相关回购债券的质押登记或向正回购方返回回购债券的日期；在人民币拆借、外币拆借中，交易双方约定的拆入方将资金划至拆出方指定的资金账户的日期；在债券借贷产品中，交易双方约定的融出方将资金划至融入方指定的资金账户的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate2

### 6.2.90 首次交割日

中文名称：首次交割日

英文名称：First Delivery Date

标识符：0667

说明：根据不同场景，具体有以下两种解释：

- a) 开始计息的日期，其计算公式为：首次交割日=成交日+清算速度（遇节假日顺延到下一交易日）；
- b) 标的债券从债券融出方向债券融入方过户、质押债券冻结的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate

#### 6.2.91 到期交割日

中文名称：到期交割日

英文名称：Delivery Date to Maturity

标识符：0668

说明：根据不同场景，具体有以下两种解释：

- a) 到期清算的日期，其计算公式为：到期交割日=起息日+回购期限（遇节假日顺延到下一交易日）；
- b) 标的债券从债券融入方向债券融出方过户、债券融入方向债券融出方支付借贷费用且质押债券解押的日期，其计算公式为：到期交割日=首次结算日+借贷期限（遇节假日顺延到下一工作日）。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate2

#### 6.2.92 实际占款天数

中文名称：实际占款天数

英文名称：Actual Cash Holding Days

标识符：0315

说明：资金融入方实际持有资金的天数。实际占款天数的计算公式为：实际占款天数=到期结算日-首次结算日。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：CashHoldingDays

#### 6.2.93 拆借金额

中文名称：拆借金额

英文名称：Lending Amount

标识符：0669

说明：拆入/拆出的资金总额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IOIQty或者LastQty或者OrderQty或者LegIOIQty

#### 6.2.94 应计利息

中文名称：应计利息

英文名称：Accrued Interest

标识符：0330

说明：从上一付息日（或起息日）到结算日之间累计的按百元面值计算的债券发行人应付给债券持有人的利息。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：AccruedInterestRate 或者 AccruedInterestAmt 或者 LegAccruedInterestAmt 或者 UnderlyingAccruedInterestAmt

#### 6.2.95 到期还款金额

中文名称：到期还款金额

英文名称：Maturity Amount

标识符：0670

说明：还款日拆入方还给拆出方的总金额，等于成交金额与利息之和。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：SettlCurrAmt2 或者 LegSettlCurrAmt2

#### 6.2.96 到期还款日

中文名称：到期还款日

英文名称：Maturity Payment Date

标识符：0671

说明：拆借合约中约定的借入方返还借出方的日期。到期还款日的计算公式为：到期还款日=起息日+拆借期限（遇节假日顺延到下一交易日），是到期清算的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：SettlDate2

#### 6.2.97 交易货币

中文名称：交易货币

英文名称：Dealt Currency

标识符：0273

说明：按照GB/T 12406规定，外汇交易时作为交易标的的货币代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Currency 或者 LegCurrency

#### 6.2.98 对应货币

中文名称：对应货币

英文名称：Contra Currency

标识符：0672

说明：按照GB/T 12406规定，一个货币对中与交易货币相对应的货币代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.99 交易货币金额

中文名称：交易货币金额

英文名称: Dealt Amount  
标识符: 0458  
说明: 以交易货币表示的金额。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: LastQty或者LegLastQty

#### 6.2.100 对应货币金额

中文名称: 对应货币金额  
英文名称: Contra Amount  
标识符: 0673  
说明: 以对应货币表示的金额。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: CalculatedCcyLastQty或者LegCalculatedCcyLastQty

#### 6.2.101 即期汇率

中文名称: 即期汇率  
英文名称: Spot Exchange Rate  
标识符: 0674  
说明: 银行间外汇市场两种货币在即期交易中互相兑换的价格。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: LastSpotRate或者LegLastSpotRate

#### 6.2.102 即期起息日

中文名称: 即期起息日  
英文名称: Spot Value Date  
标识符: 0675  
说明: 即期交易双方履行资金划拨真正执行生效的日期。  
数据类型: 日期  
取值: 无  
IMIX 域名: SpotDate或者LegSpotDate或者SettlDate

#### 6.2.103 近端基准货币金额

中文名称: 近端基准货币金额  
英文名称: Near-Leg Base Amount  
标识符: 0676  
说明: 近端基准货币计量的交易量。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.2.104 近端汇率

中文名称：近端汇率

英文名称：Near-Leg Exchange Rate

标识符：0677

说明：交易双方约定的第一次交割货币所使用的汇率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastPx

#### 6.2.105 近端掉期点

中文名称：近端掉期点

英文名称：Near-Leg Swap Point

标识符：0678

说明：近端掉期全价与即期价格之间的点差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastForwardPoints或者LastForwardPoints

#### 6.2.106 近端非基准货币金额

中文名称：近端非基准货币金额

英文名称：Near-Leg Term Amount

标识符：0679

说明：近端非基准货币计量的交易量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.107 近端折算率

中文名称：近端折算率

英文名称：Near-Leg Conversion Proportion

标识符：0680

说明：近端基准货币或非基准货币对美元的折算率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.108 近端折美元金额

中文名称：近端折美元金额

英文名称：Near-Leg Risk Amount

标识符：0681

说明：近端美元计量的交易量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegRiskOrderQty或者RiskLastQty

#### 6.2.109 近端期限

中文名称：近端期限

英文名称：Near-Leg Term

标识符：0682

说明：掉期交易近端所跨时间长度。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：LegSettlType

#### 6.2.110 近端起息日

中文名称：近端起息日

英文名称：Near-Leg Value Date

标识符：0683

说明：掉期中第一次货币交割的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：LegSettlDate

#### 6.2.111 远端期限

中文名称：远端期限

英文名称：Far-Leg Term

标识符：0684

说明：掉期交易远端所跨时间长度。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：LegSettlType

#### 6.2.112 远端起息日

中文名称：远端起息日

英文名称：Far-Leg Value Date

标识符：0685

说明：掉期中第二次货币交割的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：LegSettlDate

#### 6.2.113 远端基准货币金额

中文名称：远端基准货币金额

英文名称：Far-Leg Base Amount

标识符：0686



说明：远端基准货币计量的交易量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.114 远端汇率

中文名称：远端汇率

英文名称：Far-Leg Exchange Rate

标识符：0687

说明：交易双方约定的第二次交割货币所使用的汇率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastPx

#### 6.2.115 远端掉期点

中文名称：远端掉期点

英文名称：Far-Leg Swap Point

标识符：0688

说明：远端掉期全价与即期价格之间的点差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastForwardPoints或者LastForwardPoints

#### 6.2.116 远期全价

中文名称：远期全价

英文名称：Forward All-in Rate

标识符：0689

说明：交易双方约定的在远期起息日基准货币交换非基准货币的价格。远期全价的计算公式为：远期全价=即期汇率+远期点。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastPx或者LastPx

#### 6.2.117 掉期全价

中文名称：掉期全价

英文名称：Swap All-in Rate

标识符：0690

说明：交易双方约定的在起息日基准货币交换非基准货币的价格。包括近端掉期全价和远端掉期全价。掉期全价的计算公式为：掉期全价=即期汇率+相应期限掉期点。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLastPx

#### 6.2.118 远端非基准货币金额

中文名称：远端非基准货币金额  
英文名称：Far-Leg Term Amount  
标识符：0691  
说明：远端非基准货币计量的交易量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.2.119 远端折算率

中文名称：远端折算率  
英文名称：Far-Leg Conversion Proportion  
标识符：0692  
说明：远端基准货币或非基准货币对美元的折算率。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.2.120 远端折美元金额

中文名称：远端折美元金额  
英文名称：Far-Leg Risk Amount  
标识符：0693  
说明：远端美元计量的交易量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：LegRiskOrderQty或者RiskLastQty

#### 6.2.121 交易品种

中文名称：交易品种  
英文名称：Instrument  
标识符：0461  
说明：可交易的产品种类。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.2.122 本金交换形式

中文名称：本金交换形式  
英文名称：Principal Exchange Form  
标识符：0694  
说明：货币掉期本金交换的形式。  
数据类型：文本

取值：期初期末各交换一次本金、期初期末都不交换本金

IMIX 域名：NotionalExchangeType

#### 6.2.123 残段

中文名称：残段

英文名称：Stub

标识符：0695

说明：包括付息残段和计息残段，如无特别约定，残段指付息残段。

数据类型：文本

取值：残段前置、残段后置

IMIX 域名：StubIndicator

#### 6.2.124 适用利率

中文名称：适用利率

英文名称：Applicable Interest Rate

标识符：0697

说明：在定息周期或计息残段计算利息时使用的利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.125 利率期限

中文名称：利率期限

英文名称：Interest Term

标识符：0698

说明：1st leg或2nd leg付款的利率期限，仅对浮动利率有效。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.126 期差合约利率

中文名称：期差合约利率

英文名称：Spread Interest Rate

标识符：0699

说明：期差合约交易中利息与合约金额的比值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.127 定息规则

中文名称：定息规则

英文名称：Fixing Rule

标识符：0700

说明：确定定价日与起息日关系的规则，属于定价日规则的一部分。

数据类型：文本

取值：V-0、V-1、V-2

IMIX 域名：LegInterestFixDateAdjustment

#### 6.2.128 定息周期

中文名称：定息周期

英文名称：Fixing Frequency

标识符：0701

说明：又称利率重置周期。货币掉期交易中每隔一段固定的期限就会重新确定用于计算利息支付的浮动利率，该期限即定息周期。利率重置频率隐含的期限即利率重置周期，定息频率隐含的期限即定息周期。

数据类型：文本

取值：1W、2W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、7M、8M、9M、10M、11M、1Y、7D

IMIX 域名：LegInterestAccrualResetFrequency

#### 6.2.129 付息周期

中文名称：付息周期

英文名称：Payment Frequency

标识符：0443

说明：货币掉期交易中交易双方每隔一段固定的期限会向对方支付换入货币计算的利息金额，该期限即为付息周期，也可定义为付息频率隐含的期限。

数据类型：文本

取值：1W、2W、3W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、7M、8M、9M、10M、11M、1Y

IMIX 域名：CouponPaymentFrequency或者LegCouponPaymentFrequency

#### 6.2.130 折美元率

中文名称：折美元率

英文名称：Conversion Proportion

标识符：0702

说明：又称折算率、美元折算率。基准货币或非基准货币对美元的折算率。

具体有以下两种解释：

a) 对于含美元的货币对：

- 1) 若交易货币为美元，折算率=1；
- 2) 若交易货币为非美元且为基准货币，折算率=该货币对汇率；
- 3) 若交易货币为非美元且为非基准货币，折算率=1÷该货币对汇率。

b) 对于不含美元的货币对：

- 1) 若交易货币为基准货币，折算率=(交易货币÷USD 买入价+交易货币÷USD 卖出价)÷2；
- 2) 若交易货币为非基准货币，折算率=1÷[(USD÷交易货币买入价+USD÷交易货币卖出价)÷2]。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.131 日期调整规则

中文名称：日期调整规则

英文名称：Date Adjustment Rule

标识符：0703

说明：基准利率类型对应的日期调整规则。

数据类型：文本

取值：上一营业日准则、下一营业日准则、经调整的下一营业日准则

IMIX 域名：无

#### 6.2.132 付息假日

中文名称：付息假日

英文名称：Payment Holiday

标识符：0704

说明：基准利率类型对应的付息假日。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.133 交易类型

中文名称：交易类型

英文名称：Trading Type

标识符：0288

说明：依据期权所赋予的权利不同区分的类别。

数据类型：文本

取值：基准货币看涨期权（等同于非基准货币看跌期权）、基准货币看跌期权（等同于非基准货币看涨期权）

IMIX 域名：PutOrCall

#### 6.2.134 行权方式

中文名称：行权方式

英文名称：Exercise Method

标识符：0705

说明：依据期权行权时间不同区分的类别。

数据类型：文本

取值：欧式期权、美式期权

IMIX 域名：DerivativeExerciseStyle

#### 6.2.135 期权类型

中文名称：期权类型

英文名称：Option Type

标识符：0706

说明：根据不同划分方式，划分出的期权类型。

数据类型：文本

取值：根据不同划分方式，具体取值如下：

a) 期权合约标的物的不同：现货期权、期货期权；

b) 从买方的权利来划分：看涨期权、看跌期权；

c) 行使期权期限的不同：美式期权、欧式期权；普通期权、奇异期权。

IMIX 域名：OptPayoutType

#### 6.2.136 行权交易基准货币交易方向

中文名称：行权交易基准货币交易方向

英文名称：Exercise Trading Base Direction

标识符：0707

说明：期权交易行权时，基准货币的交易方向。

数据类型：文本

取值：买入、卖出

IMIX 域名：Side

#### 6.2.137 行权交易非基准货币交易方向

中文名称：行权交易非基准货币交易方向

英文名称：Exercise Trading Term Direction

标识符：0708

说明：期权交易行权时，非基准货币的交易方向。

数据类型：文本

取值：买入、卖出

IMIX 域名：Side

#### 6.2.138 基准货币名义本金

中文名称：基准货币名义本金

英文名称：Base Currency Notional Principal

标识符：0709

说明：期权交易行权时，基准货币计量的名义本金金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OrderQty或者IOIQty

#### 6.2.139 非基准货币名义本金

中文名称：非基准货币名义本金

英文名称：Term Currency Notional Principal

标识符：0710

说明：期权交易行权时，非基准货币计量的名义本金金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OrderQty或者IOIQty

#### 6.2.140 行权日

中文名称：行权日

英文名称：Exercise Date

标识符：0711

说明：期权买方选择是否行权的日期或含权债行使权利的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EventDate或者MaturityDate

#### 6.2.141 行权价格

中文名称：行权价格

英文名称：Strike Price/Exercise Price

标识符：0712

说明：交易双方约定在未来某一日期进行外汇交易的汇率，或含权债行使权利时交易的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：StrikePrice或者EventPx

#### 6.2.142 折美元金额

中文名称：折美元金额

英文名称：Risk Amount

标识符：0348

说明：外汇交易按成交时的美元市场汇率折算成的美元金额，通常用作交易量统计的基准。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskLastQty或者LegRiskOrderQty

#### 6.2.143 即期参考汇率

中文名称：即期参考汇率

英文名称：Spot Benchmark

标识符：0713

说明：用以试算期权费和期权各项风险指标的即期参考汇率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.144 期权费支付日

中文名称：期权费支付日

英文名称：Premium Date

标识符：0714

说明：交易双方约定的期权买方向期权卖方支付期权费的日期，通常为该货币对的即期起息日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：PaymentDate

#### 6.2.145 交割日

中文名称：交割日

英文名称：Delivery Date

标识符：0715

说明：由交易双方约定的交割资金的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：DeliveryDate或者SettlDate或者EndDate

#### 6.2.146 期权费

中文名称：期权费

英文名称：Option Premium

标识符：0716

说明：期权买方购买期权所支付的费用，即期权价格（Option Price）。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OptPremiumAmt

#### 6.2.147 期权费类型

中文名称：期权费类型

英文名称：Premium Type

标识符：0717

说明：双方约定的期权费率的报价表示方式，包括非基准货币百分比（Term%）和基点（Pips）。

数据类型：文本

取值：Pips、Term%

IMIX 域名：OptPremiumBasis

#### 6.2.148 期权费率

中文名称：期权费率

英文名称：Premium Rate

标识符：0718

说明：双方约定的用以计算期权费金额的比率，可约定选择不同的期权费类型进行报价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OptPremiumValue

#### 6.2.149 行权截止时间

中文名称：行权截止时间

英文名称：Exercise Cut Off Time

标识符：0719



说明：交易双方约定的在到期日行权的最晚时点，一般不应超过到期日当天的15:00。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：ExpireTime

#### 6.2.150 行权状态

中文名称：行权状态

英文名称：Exercise Status

标识符：0720

说明：期权买方发出行权通知后的期权行权状态。

数据类型：文本

取值：Valid、Exercised、Expired

IMIX 域名：DerivativeExerciseStatus

#### 6.2.151 交割方式

中文名称：交割方式

英文名称：Delivery Method

标识符：0721

说明：交易双方在期权交易达成时约定的期权买方行权后在交割日进行资金清算的方式。

数据类型：文本

取值：全额交割、差额交割

IMIX 域名：OptSettlAmtType

#### 6.2.152 行权日中间价

中文名称：行权日中间价

英文名称：Central Parity Rate on Exercise Date

标识符：0722

说明：行权日的人民币外汇中间价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：StrikeDayPrice

#### 6.2.153 轧差金额

中文名称：轧差金额

英文名称：Netting Amount

标识符：0723

说明：差额交割方式下，约定的执行价格与当日中间价进行轧差得出的差额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：SettlCurrAmt

#### 6.2.154 Delta

中文名称：Delta

英文名称: Delta

标识符: 0724

说明: 外汇即期价格单位变动带来外汇期权价格的绝对变动值, 是用以衡量外汇期权风险状况的重要指标, 通常用来衡量头寸的风险。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.155 Gamma

中文名称: Gamma

英文名称: Gamma

标识符: 0725

说明: 外汇即期价格单位变动带来外汇期权Delta值的绝对变动值, 反映即期价格对delta的影响程度。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.156 Vega

中文名称: Vega

英文名称: Vega

标识符: 0726

说明: 外汇即期价格波动率单位变动带来外汇期权价格的绝对变动值, 衡量波动率对期权价格的影响幅度。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.157 Theta

中文名称: Theta

英文名称: Theta

标识符: 0727

说明: 外汇期权到期时间单位变动带来外汇期权价格的绝对变动值, 衡量时间变化对期权价格的影响幅度。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.158 Rho

中文名称: Rho

英文名称: Rho

标识符: 0728

说明: 利率变化对期权价格的影响。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.159 隐含波动率

中文名称：隐含波动率

英文名称：Implied Volatility

标识符：0729

说明：汇率在一段时间内变动的程度，是衡量期权价格波动幅度的指标，一般采用标准方差计算，是外汇期权报价的标的，以百分比表示。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Volatility

#### 6.2.160 本国货币利率

中文名称：本国货币利率

英文名称：Domestic Rate

标识符：0730

说明：在计算Delta的值时，需要用到的人民币利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.161 外国货币利率

中文名称：外国货币利率

英文名称：Foreign Rate

标识符：0731

说明：用以计算Delta头寸的美元利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.162 外汇期权结算货币

中文名称：外汇期权结算货币

英文名称：Option Settlement Currency

标识符：0732

说明：结算时使用的币种，期权交易中限定为人民币。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：StrikeCurrency

#### 6.2.163 基准货币金额

中文名称：基准货币金额

英文名称: Base Currency Amount

标识符: 0453

说明: 以基准货币表示的金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.164 非基准货币金额

中文名称: 非基准货币金额

英文名称: Term Currency Amount

标识符: 0733

说明: 以非基准货币表示的金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.2.165 远期汇率

中文名称: 远期汇率

英文名称: Forward Exchange Rate

标识符: 0734

说明: 银行间外汇市场上, 交易双方约定的在未来某一日期两种货币互相兑换的价格。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: LastPx

#### 6.2.166 远期点

中文名称: 远期点

英文名称: Forward Point

标识符: 0735

说明: 远期汇率减去即期汇率的基点数。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: LastForwardPoints

#### 6.2.167 远期起息日

中文名称: 远期起息日

英文名称: Forward Value Date

标识符: 0736

说明: 远期交易双方履行资金划拨真正执行生效的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: SettlDate

### 6.2.168 轧差清算远期定价日

中文名称：轧差清算远期定价日  
英文名称：Netting-Settled Forward Fixed Date  
标识符：0737  
说明：外汇远期轧差清算交易中确定轧差使用的即期汇率的日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.2.169 待偿期

中文名称：待偿期  
英文名称：Term to Maturity (TTM)  
标识符：0738  
说明：债券的剩余存续期，即当前日期至债券到期日之间的期限。待偿期的计算公式为：待偿期=到期日-当前交易日。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：TermToMaturity

### 6.2.170 债券主体评级

中文名称：债券主体评级  
英文名称：Credit Rating  
标识符：1210  
说明：发债主体的信用评级。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：CreditRating

### 6.2.171 净价

中文名称：净价  
英文名称：Net Price  
标识符：0219  
说明：扣除按债券票面利率计算的应计利息后的债券价格。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：UnderlyingPx或者LegPrice或者Price或者LastPx

### 6.2.172 前收盘净价

中文名称：前收盘净价  
英文名称：Previous Closing Net Price  
标识符：0246  
说明：前一工作日该债券最后一笔交易的净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘净价）

#### 6.2.173 前收盘全价

中文名称：前收盘全价

英文名称：Previous Closing Dirty Price

标识符：0247

说明：前一工作日该债券最后一笔交易的全价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘全价）

#### 6.2.174 前收盘加权平均净价

中文名称：前收盘加权平均净价

英文名称：Previous Closing Weighted Average Net Price

标识符：0224

说明：前一工作日该债券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易）。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘加权平均净价）

#### 6.2.175 开盘净价

中文名称：开盘净价

英文名称：Opening Net Price

标识符：0331

说明：当日该债券第一笔交易的净价。债券的开盘价通过集合竞价方式产生，不能产生开盘价的，以连续竞价方式产生。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘净价）

#### 6.2.176 开盘全价

中文名称：开盘全价

英文名称：Opening Dirty Price

标识符：0332

说明：当日该债券第一笔交易的全价。债券的开盘价通过集合竞价方式产生，不能产生开盘价的，以连续竞价方式产生。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘全价）

#### 6.2.177 收盘净价

中文名称：收盘净价

英文名称：Closing Net Price

标识符：0739

说明：当日该债券最后一笔交易的净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘净价）

#### 6.2.178 收盘加权平均净价

中文名称：收盘加权平均净价

英文名称：Closing Weighted Average Net Price

标识符：0740

说明：当日该债券最后一笔交易前一分钟所有交易的成交量加权平均价（含最后一笔交易）。当日无成交的，应以前收盘加权平均净价为当日收盘加权平均净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘加权平均净价）

#### 6.2.179 加权平均净价

中文名称：加权平均净价

英文名称：Weighted Average Net Price

标识符：0741

说明：用数量作为权数进行加权平均计算的净价价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均净价）

#### 6.2.180 加权平均全价

中文名称：加权平均全价

英文名称：Weighted Average Dirty Price

标识符：1219

说明：用数量作为权数进行加权平均计算的全价价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均全价)

#### 6.2.181 行权收益率

中文名称: 行权收益率

英文名称: Exercise Yield

标识符: 0742

说明: 含权债券的内嵌选择权被行使时的收益率。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: StipulationValue或者LegStipulationValue或者UnderlyingStipValue (JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示行权收益率)

#### 6.2.182 应计利息总额

中文名称: 应计利息总额

英文名称: Total Accrued Interest

标识符: 0320

说明: 债券应计利息的总和。应计利息总额的计算公式为: 应计利息总额=应计利息×券面总额÷100。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: AccruedInterestTotalAmt或者LegAccruedInterestTotalAmt

#### 6.2.183 全价

中文名称: 全价

英文名称: All Price

标识符: 0221

说明: 未来现金流的现值之和, 等于净价与应计利息之和。全价的计算公式为: 全价=净价+应计利息。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: UnderlyingDirtyPrice或者DirtyPrice或者LegDirtyPrice

#### 6.2.184 结算金额

中文名称: 结算金额

英文名称: Settlement Amount

标识符: 0169

说明: 交易双方约定的在结算日交易一方应向另一方支付或收取的结算货币金额。远期交易结算时买方向卖方支付的资金额。结算金额的计算公式为: 结算金额=(远期交易净价+结算日应计利息)×标的债券券面总额÷100。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: SettlCurrAmt或者LegSettlCurrAmt



### 6.2.185 交易金额

中文名称：交易金额

英文名称：Transaction Amount

标识符：0274

说明：又称货币金额。在涉及超过一种货币的交易中，交易双方就某种货币约定的金额。根据本币市场和外汇市场划分，具体有以下两种解释：

- a) 本币市场中，现券买卖为净价金额，资产支持证券为净价金额，债券远期为净价金额，买断式回购为首次净价金额，债券借贷为标的券券面总额，质押式回购为首次结算金额，信用拆借为首次结算金额，利率互换为名义本金，远期利率协议为名义本金；
- b) 外汇市场中，分为基准货币金额、非基准货币金额、交易货币金额、对应货币金额、折美元金额。除非交易双方另有约定，交易金额指基准货币金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegTradeCashAmt 或者 TradeCashAmt 或者 OrderQty 或者 IOIQty 或者 LastQty 或者 LegOrderQty

### 6.2.186 凭证价格

中文名称：凭证价格

英文名称：Voucher Price

标识符：1211

说明：信用风险缓释凭证的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Price

### 6.2.187 预期收益率

中文名称：预期收益率

英文名称：Expected Yield

标识符：0743

说明：预期收益率也称为期望收益率，是指如果没有意外事件发生时根据已知信息所预测能得到的收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：StipulationValue (JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示预期收益率)

### 6.2.188 合约期限

中文名称：合约期限

英文名称：Contract Term

标识符：0445

说明：合约生效日至到期日的天数。

数据类型：文本

取值：7D、1M、2M、3M、4M、5M、6M、7M、8M、9M、10M、11M、12M、13M、14M、15M

IMIX 域名：TradeLimitDays或者SettleType

#### 6.2.189 利率确定日

中文名称：利率确定日

英文名称：Interest Rate Fixing Date

标识符：0235

说明：根据交易双方约定的方式确定某个重置日参考利率水平的日期。除另有约定，利率确定日适用上一营业日准则。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：LegInterestAccrualDate或者InterestFixDate或者InterestAccrualDate

#### 6.2.190 贴现利率

中文名称：贴现利率

英文名称：Discount Rate

标识符：0355

说明：远期利率协议将期末现金流贴现至期初采用的利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：StipulationValue（JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示贴现利率）

#### 6.2.191 远期期限

中文名称：远期期限

英文名称：Forward Term

标识符：0744

说明：远期合同交割日期与当日之间的期限。

数据类型：文本

取值：7D、1M、2M、3M、4M、5M、6M、7M、8M、9M、10M、11M、12M、13M、14M、15M

IMIX 域名：TradeFwdDays

#### 6.2.192 借贷期限

中文名称：借贷期限

英文名称：Lending Term

标识符：0466

说明：债券借入/借出的理论期限。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：TradeLimitDays

#### 6.2.193 标的债券券面总额

中文名称：标的债券券面总额

英文名称: Total Face Value  
 标识符: 1212  
 说明: 借入/借出的债券的券面总额。  
 数据类型: 数值  
 取值: 无  
 IMIX 域名: UnderlyingQty

#### 6.2.194 借贷费率

中文名称: 借贷费率  
 英文名称: Lending Rate  
 标识符: 0745  
 说明: 以年利率行使标识的债券借贷成本, 债券借贷交易以借贷费率报价。  
 数据类型: 数值  
 取值: 无  
 IMIX 域名: Price

#### 6.2.195 借贷费用

中文名称: 借贷费用  
 英文名称: Lending Fee  
 标识符: 0746  
 说明: 到期时债券融入方向融出方支付的费用。  
 数据类型: 数值  
 取值: 无  
 IMIX 域名: MiscFeeAmt (JR/T 0066一般以“MiscFee”组件中的Type域和Amt域组合表示借贷费用)

#### 6.2.196 争议解决方式

中文名称: 争议解决方式  
 英文名称: Disputes Settlement Method  
 标识符: 0264  
 说明: 交易双方约定在发生争议情况下的解决方式, 可选择仲裁或者诉讼。  
 数据类型: 文本  
 取值: 诉讼、仲裁  
 IMIX 域名: DisputeSettlementMethod

#### 6.2.197 质押债券置换安排

中文名称: 质押债券置换安排  
 英文名称: Replacement Option of Collateralized Bonds  
 标识符: 0747  
 说明: 交易双方约定在借贷期限内是否可置换质押债券, 可选择是或者否。  
 数据类型: 文本  
 取值: 无  
 IMIX 域名: 无

#### 6.2.198 实际占券天数

中文名称：实际占券天数

英文名称：Actual Security Holding Days

标识符：0316

说明：债券融入方实际持有标的债券天数。实际占券天数的计算公式为：实际占券天数=到期结算日-首次结算日。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.199 质押债券数目

中文名称：质押债券数目

英文名称：Pledge Coupon Number

标识符：0748

说明：质押式回购交易或债券借贷交易达成过程中，双方约定的质押债券的只数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.200 折算比例

中文名称：折算比例

英文名称：Conversion Proportion

标识符：0749

说明：实际融入金额占质押债券券面总额的百分比。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingStipValue（JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示折算比例）

#### 6.2.201 远期净价

中文名称：远期净价

英文名称：Forward Net Price

标识符：0750

说明：交易双方在成交日约定、在结算日进行交割的标的债券净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingPx

#### 6.2.202 远期到期收益率

中文名称：远期到期收益率

英文名称：Forward Maturity Yield

标识符：0751

说明：交易双方在成交日约定的标的债券在结算日的到期收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingStipValue（JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示远期到期收益率）

#### 6.2.203 质押券种类

中文名称：质押券种类

英文名称：Pledged Coupon Type

标识符：0752

说明：质押式回购交易达成过程中，双方约定的质押债券的种类。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.204 每百元本金额

中文名称：每百元本金额

英文名称：Principal Amount Per 100 Yuan

标识符：0024

说明：每百元待清偿的本金金额，该金额随着资产支持证券的逐期偿付而递减。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Principal

#### 6.2.205 本金额

中文名称：本金额

英文名称：Principal

标识符：1213

说明：资产支持证券依据交易量算出的剩余本金总额，为每百元本金额与券面总额之积。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegTotalPrincipal或者TotalPrincipal

#### 6.2.206 拆借币种

中文名称：拆借币种

英文名称：Lending Currency

标识符：0753

说明：金融机构进行外币头寸余额拆借的外币币种。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Currency

#### 6.2.207 到期结算金额

中文名称：到期结算金额  
英文名称：Settlement Amount to Maturity  
标识符：0228  
说明：交易到期时资金交割的金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：LegSettlCurrAmt2或者SettlCurrAmt2

#### 6.2.208 标准期限

中文名称：标准期限  
英文名称：Tenor/Fixed Period  
标识符：0754  
说明：起息日与该货币对即期交易起息日时间差为固定时间段的期限。  
数据类型：文本  
取值：TODAY、TOM、Spot、1D、1W、2W、3W、1M、2M、3M、4M、5M、6M、9M、1Y、18M、nY (n=2, 3, 4, 5, …

10)

IMIX 域名：SettlType或者LegSettlType

#### 6.2.209 补充条款

中文名称：补充条款  
英文名称：Supplementary Terms  
标识符：0756  
说明：询价过程中，交易员可选择在报价输入窗口的补充条款字段输入补充信息。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：Text

#### 6.2.210 收益率

中文名称：收益率  
英文名称：Yield  
标识符：0757  
说明：投资的回报率，一般以年度百分比表达，根据当时市场价格、面值、息票利率以及距离到期日时间计算。对公司而言，收益率指净利润占使用的平均资本的百分比。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：StipulationValue或者LegStipulationValue或者UnderlyingStipValue (JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示收益率)

#### 6.2.211 前收盘收益率

中文名称：前收盘收益率  
英文名称：Previous Closing Yield  
标识符：0248  
说明：前一工作日该债券最后一笔交易的收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘收益率）

#### 6.2.212 开盘收益率

中文名称：开盘收益率

英文名称：Opening Yield

标识符：0329

说明：当日该债券第一笔交易的收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘收益率）

#### 6.2.213 收盘收益率

中文名称：收盘收益率

英文名称：Closing Yield

标识符：0054

说明：当日该债券最后一笔交易的收益率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘收益率）

#### 6.2.214 加权平均收益率

中文名称：加权平均收益率

英文名称：Weighted Average Yield

标识符：0241

说明：当日该债券所有交易收益率的加权平均。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均收益率）

#### 6.2.215 可供出售余额

中文名称：可供出售余额

英文名称：Available-for-Sale Balance

标识符：0758

说明：机构持有可供出售债券的余额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegLeaveQty或者LeavesTotalQty或者LeavesQty

#### 6.2.216 清算货币

中文名称：清算货币  
英文名称：Clearing Currency  
标识符：0759  
说明：外汇NDF中用于轧差清算的货币。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：NDFCurrency

#### 6.2.217 做市商类型

中文名称：做市商类型  
英文名称：Market Maker Type  
标识符：0201  
说明：标识机构是否为做市商机构。  
数据类型：文本  
取值：做市商、尝试做市商、非做市商  
IMIX 域名：无

#### 6.2.218 结算日调整

中文名称：结算日调整  
英文名称：Settlement Date Adjustment  
标识符：0165  
说明：原定结算日遇法定节假日后作出的提前或延迟的变动。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.2.219 成交量标志

中文名称：成交量标志  
英文名称：Trade Volume Flag  
标识符：1111  
说明：根据交易金额0-1M, 1-3M, 3-5M, 5-10M, 10-15M, 15-20M, 20-30M, 30-40M, 40-50M, 50M设置不同标志位（0~9）。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：TradeVolumeFlag  
注：该数据元中的M为百万。

#### 6.2.220 初始交换标志位

中文名称：初始交换标志位  
英文名称：Initial Exchange Flag  
标识符：1112



说明：标志利率互换是否存在初始交换。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：IniExReqIndicator

#### 6.2.221 名义本金重设置量

中文名称：名义本金重设置量

英文名称：Notional Reset Principal

标识符：0391

说明：名义本金的变化数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OrdQtyResetAmount

#### 6.2.222 名义本金重设比率

中文名称：名义本金重设比率

英文名称：Notional Principal Reset Percentage

标识符：0384

说明：名义本金的变化比率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OrdQtyResetPercentage

#### 6.2.223 名义本金重设要求

中文名称：名义本金重设要求

英文名称：Notional Principal Reset Required

标识符：0390

说明：名义本金在合约期间是否变化。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：OrdQtyResetRequired

#### 6.2.224 名义本金重设类型

中文名称：名义本金重设类型

英文名称：Notional Principal Reset Type

标识符：0385

说明：名义本金是递增变化还是递减变化。

数据类型：文本

取值：递增、递减

IMIX 域名：OrdQtyResetType

#### 6.2.225 名义本金重设频率

中文名称：名义本金重设频率

英文名称: Notional Principal Reset Frequency

标识符: 0388

说明: 名义本金的变化频率。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: OrdQtyResetFrequency

#### 6.2.226 最高限价

中文名称: 最高限价

英文名称: Highest Limit

标识符: 0017

说明: 在市场行情中当日最高的限价报价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高限价)

#### 6.2.227 最低限价

中文名称: 最低限价

英文名称: Lowest Limit

标识符: 0096

说明: 在市场行情中当日最低的限价报价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低限价)

#### 6.2.228 最高收益率

中文名称: 最高收益率

英文名称: Highest Yield

标识符: 0016

说明: 在市场行情中当日最高的收益率。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高收益率)

#### 6.2.229 最低收益率

中文名称: 最低收益率

英文名称: Lowest Yield

标识符: 0095

说明: 在市场行情中当日最低的收益率。

数据类型: 数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低收益率）

#### 6.2.230 最高利差

中文名称：最高利差

英文名称：Highest Spread

标识符：0022

说明：在市场行情中当日最高的利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最高利差）

#### 6.2.231 最低利差

中文名称：最低利差

英文名称：Lowest Spread

标识符：0089

说明：在市场行情中当日最低的利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最低利差）

#### 6.2.232 最新利差

中文名称：最新利差

英文名称：Latest Spread

标识符：0081

说明：最新一笔交易的利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示最新利差）

#### 6.2.233 收盘利率

中文名称：收盘利率

英文名称：Closing Interest Rate

标识符：0049

说明：当日收盘前最后一笔交易的利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘利率）

#### 6.2.234 前收盘利差

中文名称：前收盘利差

英文名称：Previous Closing Spread

标识符：0245

说明：上个交易日的收盘利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前收盘利差）

#### 6.2.235 收盘利差

中文名称：收盘利差

英文名称：Closing Spread

标识符：0050

说明：当日收盘前最后一笔交易的利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示收盘利差）

#### 6.2.236 开盘利差

中文名称：开盘利差

英文名称：Opening Spread

标识符：0328

说明：当前交易日第一笔交易的利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示开盘利差）

#### 6.2.237 前加权平均利差

中文名称：前加权平均利差

英文名称：Previous Weighted Average Spread

标识符：0225

说明：上个交易日的加权平均利差。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均利差）

#### 6.2.238 加权平均利差

中文名称：加权平均利差

英文名称: Weighted Average Spread

标识符: 0242

说明: 以数量为权重计算的平均利差。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均利差)

#### 6.2.239 前加权平均远期净价

中文名称: 前加权平均远期净价

英文名称: Previous Weighted Average Forward Net Price

标识符: 0249

说明: 上个交易日的加权平均远期净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示前加权平均远期净价)

#### 6.2.240 加权平均远期净价

中文名称: 加权平均远期净价

英文名称: Weighted Average Forward Net Price

标识符: 0244

说明: 以数量为权重计算的平均远期净价。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MDEntryPx (JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示加权平均远期净价)

#### 6.2.241 支付频率

中文名称: 支付频率

英文名称: Coupon Payment Frequency

标识符: 0058

说明: 支付利息的频率。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: LegCouponPaymentFrequency或者CouponPaymentFrequency

#### 6.2.242 中间价

中文名称: 中间价

英文名称: Central Parity Rate

标识符: 0259

说明: 由中国人民银行授权中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心于每个工作日上午9时15分对外公布的、作为当日银行间即期外汇市场人民币对美元、欧元、日元等货币对的汇率中间价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示中间价）

#### 6.2.243 基准曲线名称

中文名称：基准曲线名称

英文名称：Benchmark Curve Name

标识符：0393

说明：浮动利率基准曲线的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkCurveName或者NestedBenchmarkCurveName

#### 6.2.244 参考价日期

中文名称：参考价日期

英文名称：Reference Price Date

标识符：1128

说明：用于记录某参考价相关信息的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.245 报价日期

中文名称：报价日期

英文名称：Quote Date

标识符：1129

说明：某笔报价成功报入系统时服务器记录的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：QuoteTime

#### 6.2.246 质押券券面总额

中文名称：质押券券面总额

英文名称：Pledged Bonds Nominal Volume

标识符：1145

说明：质押债券的总面额。券面总额的计算公式为：券面总额=债券数量×单张债券面值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingQty

#### 6.2.247 个性化合约结算金额

中文名称：个性化合约结算金额

英文名称：Individual Contracts Settlement Amount

标识符：1148

说明：个性化合约交易双方约定的在结算日交易一方应向另一方支付或收取的结算货币金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.248 首次支付开始日期

中文名称：首次支付开始日期

英文名称：First Payment Starting Date

标识符：1149

说明：首次进行利息计算的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：FirstPeriodStartDate

#### 6.2.249 首次支付结束日期

中文名称：首次支付结束日期

英文名称：First Payment Ending Date

标识符：1150

说明：在不同交易产品中，具体有以下三种解释：

- a) 在回购交易中，表示交易双方约定的逆回购方将资金划至正回购方指定的资金账户，且正回购方在相关回购债券上完成质押登记或将相关回购债券转让给逆回购方的日期；
- b) 在人民币拆借中，表示交易双方约定的拆出方将资金划至拆入方指定的资金账户的日期；
- c) 在债券借贷产品中，表示交易双方约定的融入方将资金划至融出方指定的资金账户的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.2.250 点差

中文名称：点差

英文名称：Pips

标识符：1151

说明：又称基点价差，在浮动利率基础上加、减的基点数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Spread

#### 6.2.251 支付金额

中文名称：支付金额

英文名称：Payment Amount

标识符：1152

说明：交易双方约定的在结算日交易一方应向另一方支付或收取的结算货币金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：SettlCurrAmt或者LegSettlCurrAmt

## 6.2.252 合约代码

中文名称：合约代码

英文名称：Contract Code

标识符：1197

说明：用于记录特定产品的合约的唯一编码标识，如标准债券远期产品中的合约代码“BFG3\_1406”。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID

## 6.3 事件

### 6.3.1 交易模式名称

中文名称：交易模式名称

英文名称：Trading Mode Name

标识符：0760

说明：交易模式的名称。

数据类型：文本

取值：指令驱动、报价驱动、协商交易、拍卖

IMIX 域名：无

### 6.3.2 交易方式名称

中文名称：交易方式名称

英文名称：Trading Method Name

标识符：0761

说明：交易方式的名称。

数据类型：文本

取值：连续撮合、集中竞价、询价、点击成交、限价订单、协商交易、报价拍卖、招标拍卖

IMIX 域名：无

### 6.3.3 订单类型名称

中文名称：订单类型名称

英文名称：Order Type Name

标识符：0762

说明：订单类型的名称。

数据类型：文本

取值：限价订单、市价订单、止损市价订单、冰山订单、OCO订单、直接订单、期差订单、内隐订单、外隐订单

IMIX 域名：OrdType



#### 6.3.4 订单编号

中文名称：订单编号

英文名称：Order ID

标识符：0118

说明：交易员提交新建的订单时，系统遵循一定的规则编制的唯一代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：OrderID

#### 6.3.5 订单创建时间

中文名称：订单创建时间

英文名称：Order Creation Time

标识符：0763

说明：交易员完成新建订单相关要素填写并保存至交易平台的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

#### 6.3.6 订单激活时间

中文名称：订单激活时间

英文名称：Order Activation Time

标识符：0764

说明：交易员激活“冻结”状态的订单使其进入订单簿进行撮合的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

#### 6.3.7 订单失效时间

中文名称：订单失效时间

英文名称：Order Invalid Time

标识符：0765

说明：在订单中设置的能被撮合或达成交易的最晚订单时间，超过有效时间后自动失效。默认为系统收盘时间。格式为：日期+时间（分钟）。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：ExpireTime

#### 6.3.8 订单结束时间

中文名称：订单结束时间

英文名称：Order End Time

标识符：0766

说明：用于记录订单结束时的时间，包括失效撤销或成交时的时间。

数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.9 止损监控方向

中文名称：止损监控方向  
英文名称：Stop Loss Monitor Direction  
标识符：0767  
说明：用户指定的止损价格的监控方向，适用于止损市价订单。  
数据类型：文本  
取值：监控买价、监控卖价  
IMIX 域名：无

### 6.3.10 止损触发价格

中文名称：止损触发价格  
英文名称：Stop Loss Trigger Price  
标识符：0768  
说明：止损市价订单设定的止损价格，当监控方向的市场报价达到或超过该止损价格时，订单在此时被激活，与市场最优价成交。适用于止损市价订单。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.11 已成交量

中文名称：已成交量  
英文名称：Deal Amount  
标识符：0769  
说明：指令驱动中已经达成交易的订单量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：LastQty或者GrossTradeAmt

### 6.3.12 订单总量

中文名称：订单总量  
英文名称：Order Total Amount  
标识符：0770  
说明：指令驱动中订单成功提交至订单簿时的订单总量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：LastQty或者GrossTradeAmt

### 6.3.13 订单数量

中文名称：订单数量

英文名称: Order Total Quantity

标识符: 0771

说明: 指令驱动中订单成功提交至订单簿时的订单个数。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: NumberOfOrders

#### 6.3.14 剩余量

中文名称: 剩余量

英文名称: Surplus

标识符: 0772

说明: 指令驱动交易模式下剩余未达成交易的订单总量。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: LeavesQty或者LeavesTotalQty

#### 6.3.15 报价编号

中文名称: 报价编号

英文名称: Quote ID

标识符: 0358

说明: 交易员提交报价时, 系统遵循一定的规则编制的唯一代码。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: QuoteID

#### 6.3.16 报价时间

中文名称: 报价时间

英文名称: Quote Time

标识符: 0361

说明: 报价驱动模式下, 报价被发送的时间。

数据类型: 时间

取值: 无

IMIX 域名: QuoteTime

#### 6.3.17 报价撤销时间

中文名称: 报价撤销时间

英文名称: Quote Withdraw Time

标识符: 0773

说明: 报价驱动模式下, 报价被撤销的时间。

数据类型: 时间

取值: 无

IMIX 域名: TransactTime

### 6.3.18 报价持续有效时间

中文名称：报价持续有效时间

英文名称：Quote Valid Time

标识符：0363

说明：报价成功提交后至报价失效为止，报价有效的时间段。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.19 报价截止时间

中文名称：报价截止时间

英文名称：Quote Deadline

标识符：0774

说明：报价失效时间点。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：ValidUntilTime

### 6.3.20 报价状态

中文名称：报价状态

英文名称：Quote Status

标识符：0356

说明：报价所处的状态。手工报价分为有效和无效；查询历史报价时，无效报价状态需区分为已撤销和已超时。

数据类型：文本

取值：有效、无效（可分为已撤销、已超时）

IMIX 域名：QuoteStatus

### 6.3.21 是否匿名

中文名称：是否匿名

英文名称：Anonymous Indicator

标识符：0243

说明：用于标识该笔报价是否匿名发送。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：AnonymousIndicator

### 6.3.22 是否自动回价

中文名称：是否自动回价

英文名称：Auto Price Indicator

标识符：0775

说明：用于标识在报价驱动模式下，当询价量小于等于报价方所设置的流动性限额时，是否可由系统自动回价。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：无

### 6.3.23 请求编号

中文名称：请求编号

英文名称：Quote Request ID

标识符：0776

说明：发起方新建询价单即生成询价请求编号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：QuoteReqID

### 6.3.24 MRFQ 编号

中文名称：MRFQ编号

英文名称：MRFQ ID

标识符：0777

说明：MRFQ指批量请求报价，一笔MRFQ业务中的多条请求对应同一个MRFQ编号。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：MRFQId

### 6.3.25 询价请求发送时间

中文名称：询价请求发送时间

英文名称：Quote Request Sending Time

标识符：0778

说明：发起方发送询价请求的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

### 6.3.26 询价请求有效持续时间

中文名称：询价请求有效持续时间

英文名称：Quote Request Valid Time

标识符：0779

说明：发起方的询价请求发送成功后至询价请求失效为止，询价请求有效的时间段。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.27 询价请求截止时间

中文名称：询价请求截止时间  
英文名称：Quote Request Deadline  
标识符：0780  
说明：询价请求失效时间点。  
数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：ValidUntilTime

#### 6.3.28 回价有效持续时间

中文名称：回价有效持续时间  
英文名称：Counter-Offer Valid Time  
标识符：0781  
说明：回价方回复的价格有效时间。  
数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.29 回价截止时间

中文名称：回价截止时间  
英文名称：Price Deadline  
标识符：0782  
说明：回价方回复的价格的有效最晚时间点。  
数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.30 交易状态

中文名称：交易状态  
英文名称：Trading Status  
标识符：0783  
说明：交易进行的状态。  
数据类型：文本  
取值：提交、询价中、未确认、成交、撤销、拒绝、冻结、有效、失效、协商中、未补录、待确认、已确认、已拒绝、已撤销  
IMIX 域名：无

#### 6.3.31 限价订单类型

中文名称：限价订单类型  
英文名称：Limit Order Type  
标识符：0784  
说明：限价订单的不同分类。  
数据类型：文本  
取值：盈利、止损

IMIX 域名: OrdType

### 6.3.32 成交编号

中文名称: 成交编号

英文名称: Deal ID

标识符: 0341

说明: 成交确认后生成的成交记录号, 记录成交单的唯一标识符。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: ExecID

### 6.3.33 成交时间

中文名称: 成交时间

英文名称: Deal Time

标识符: 0334

说明: 交易双方达成交易的具体时间 (以北京时间表示)。

数据类型: 时间

取值: 无

IMIX 域名: TradeTime或者TransactTime

### 6.3.34 成交状态

中文名称: 成交状态

英文名称: Deal Status

标识符: 0344

说明: 一笔交易在交易平台中所处的状态。

数据类型: 文本

取值: 应急录入、应急删除、正常

IMIX 域名: DealTransType

### 6.3.35 成交量

中文名称: 成交量

英文名称: Traded Quantity

标识符: 0340

说明: 某一交易品种从开盘到当前时间为止的总成交量, 对债券来说是面值总额, 对回购和拆借来说是成交金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: GrossTradeAmt或者LastQty或者TradeCashAmt

### 6.3.36 成交金额

中文名称: 成交金额

英文名称: Traded Amount

标识符: 0343

说明：用于描述债券交易中成交的总金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：GrossTradeAmt或者LastQty或者TradeCashAmt

### 6.3.37 清算状态

中文名称：清算状态

英文名称：Clearing Status

标识符：0785

说明：用于标识成交交易是否已清算。

数据类型：文本

取值：承接、待承接、未承接

IMIX 域名：ClearingStatus

### 6.3.38 报价拍卖状态

中文名称：报价拍卖状态

英文名称：Quote Auction Status

标识符：0786

说明：报价拍卖过程中的状态。

数据类型：文本

取值：已撤销、待复核、发行设置待确认、待发行、发行中、发行成功、发行结果待确认、发行失败

IMIX 域名：无

### 6.3.39 申购途径

中文名称：申购途径

英文名称：Subscription Approach

标识符：0787

说明：依据申购路径的不同对申购进行的划分，包括正常投标、应急投标。

数据类型：文本

取值：正常投标、应急投标

IMIX 域名：无

### 6.3.40 申购时间

中文名称：申购时间

英文名称：Subscription Time

标识符：0788

说明：记录申购的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.41 招标状态



中文名称：招标状态

英文名称：Tendering Status

标识符：0789

说明：招标过程中的状态。

数据类型：文本

取值：已撤销、待复核、发行设置待确认、待发行、发行中、发行成功、发行结果待确认、发行失败

IMIX 域名：无

#### 6.3.42 招标拍卖类型名称

中文名称：招标拍卖类型名称

英文名称：Tendering Auction Type Name

标识符：0790

说明：用于表示招标类型的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.43 投标价位

中文名称：投标价位

英文名称：Tender Price

标识符：0791

说明：根据价格标位下限、价格标位上限和招标价位表投标步长计算得出，各投标价位取招标价位表中在价位上下限范围内（包括价位上限、价位下限）的价位。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.44 投标状态

中文名称：投标状态

英文名称：Tender Status

标识符：0792

说明：投标过程中的状态。

数据类型：文本

取值：待复核、已投标

IMIX 域名：无

#### 6.3.45 投标途径

中文名称：投标途径

英文名称：Tender Approach

标识符：0793

说明：依据投标路径的不同对投标进行的划分，包括正常投标、应急投标。

数据类型：文本

取值：正常投标、应急投标  
IMIX 域名：无

#### 6.3.46 投标时间

中文名称：投标时间  
英文名称：Tender Time  
标识符：0794  
说明：用于记录投标时间。  
数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.47 投标意向名称

中文名称：投标意向名称  
英文名称：Tender Intention Name  
标识符：0795  
说明：投标意向类型的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.48 投标量

中文名称：投标量  
英文名称：Tender Quantity  
标识符：0796  
说明：投标数量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.49 交易确认号

中文名称：交易确认号  
英文名称：Trade Confirmation ID  
标识符：0797  
说明：交易确认时系统产生的唯一编号。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：ConfirmID

#### 6.3.50 交易确认状态

中文名称：交易确认状态  
英文名称：Trade Confirmation Status  
标识符：0798

说明：用于记录确认状态。

数据类型：文本

取值：待录入、待确认、已确认、应急确认

IMIX 域名：ConfirmStatus

#### 6.3.51 交易确认时间

中文名称：交易确认时间

英文名称：Trade Confirmation Time

标识符：0799

说明：用于记录确认的时间信息。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：CnfmTime

#### 6.3.52 备案状态

中文名称：备案状态

英文名称：Recorded Deal Status

标识符：0800

说明：用于记录交易是否已备案。

数据类型：文本

取值：已备案、未备案

IMIX 域名：RecordedDealStatus

#### 6.3.53 起息日变更确认状态

中文名称：起息日变更确认状态

英文名称：Confirmation Status of Value Date Change

标识符：0801

说明：用于记录起息日变更是否已确认。

数据类型：文本

取值：待确认、已确认

IMIX 域名：无

#### 6.3.54 起息日变更确认时间

中文名称：起息日变更确认时间

英文名称：Confirmation Time of Value Date Change

标识符：0802

说明：用于记录起息日变更的确认时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.55 确认类型

中文名称：确认类型

英文名称: Confirmation Type

标识符: 0803

说明: 用于区分该笔交易是起息日变更确认或交易确认。

数据类型: 文本

取值: 交易确认、起息日变更确认

IMIX 域名: 无

### 6.3.56 冲销编号

中文名称: 冲销编号

英文名称: Writeoff ID

标识符: 0804

说明: 交易进入冲销流程时系统生成的唯一编号。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: WriteOffID

### 6.3.57 申请日期

中文名称: 申请日期

英文名称: Application Date

标识符: 0805

说明: 用于记录多边冲销的申请日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: TransactTime

### 6.3.58 清算退出日期

中文名称: 清算退出日期

英文名称: Clearing Quit Date

标识符: 0806

说明: 用于记录多边冲销的清算退出日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: WithdrawDate

### 6.3.59 清算方式变更业务类型

中文名称: 清算方式变更业务类型

英文名称: Clearing Method Change Business Type

标识符: 0807

说明: 用于记录清算方式变更选择的业务类型。

数据类型: 文本

取值: 进入净额清算、退出净额清算、提前终止

IMIX 域名: 无

### 6.3.60 清算变更申请日期

中文名称：清算变更申请日期  
英文名称：Clearing Method Change Application Date  
标识符：0809  
说明：清算方式变更的变更申请日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：TransactTime

### 6.3.61 变更日期

中文名称：变更日期  
英文名称：Change Date  
标识符：0810  
说明：清算方式变更的日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.62 清算机构处理状态

中文名称：清算机构处理状态  
英文名称：Clearing Institution Process Status  
标识符：0811  
说明：清算机构对清算方式变更的处理状态。  
数据类型：文本  
取值：审核通过、审核未通过、未反馈  
IMIX 域名：ProcessingStatus

### 6.3.63 提前终止编号

中文名称：提前终止编号  
英文名称：Early Termination ID  
标识符：0812  
说明：用于记录提前终止的唯一编号。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.64 提前终止日

中文名称：提前终止日  
英文名称：Early Termination Date  
标识符：0813  
说明：提前终止申请得到确认的日期。  
数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：WithdrawDate

### 6.3.65 终止金额结算日

中文名称：终止金额结算日

英文名称：Terminate Amount Settlement Date

标识符：0814

说明：提前终止日的下一交易日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：WithdrawAmtSettlDate

### 6.3.66 清算变更申请状态

中文名称：清算变更申请状态

英文名称：Clearing Method Change Submit Status

标识符：0815

说明：清算变更的申请状态。具体状态的含义如下：

- a) 已提交：指本方提交的清算方式变更；
- b) 已收到：指对方发送的清算方式变更；
- c) 已申请：指双方确认的清算方式变更；
- d) 已撤销：如果成交原先状态为“已提交”，则拒绝/撤销后本方和对手方状态变为“已撤销”；
- e) 已拒绝：如果成交原先状态为“已收到”，则拒绝/撤销后本方和对手方状态变为“已拒绝”；
- f) 已变更：如果原先成交状态为“已提交”，则修改后本方状态变为“已变更”。

数据类型：文本

取值：已提交、已收到、已申请、已撤销、已拒绝、已变更

IMIX 域名：无

### 6.3.67 撤销申请时间

中文名称：撤销申请时间

英文名称：Withdraw Application Time

标识符：0816

说明：撤销提前终止申请的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

### 6.3.68 合约估值

中文名称：合约估值

英文名称：Valuation

标识符：0817

说明：依据一定规则对一笔合约进行的价值估计。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：OriAgreementValue

### 6.3.69 剩余名义本金

中文名称：剩余名义本金

英文名称：Remaining Notional Principal

标识符：0818

说明：对于部分终止的合约，本次提前终止后的剩余名义本金。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LeavesTotalQty

### 6.3.70 提前终止来源

中文名称：提前终止来源

英文名称：Early Termination Source

标识符：0819

说明：提前终止申请的来源系统。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.71 终止名义本金

中文名称：终止名义本金

英文名称：Termination Notional Principal

标识符：0820

说明：需要终止清算的名义本金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：WriteOffQty

### 6.3.72 终止付款方应付金额

中文名称：终止付款方应付金额

英文名称：Amount Due of Termination Payer

标识符：0821

说明：提前终止申请中付款方应当支付的金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：WithdrawAmt

### 6.3.73 提前终止申请业务类型

中文名称：提前终止申请业务类型

英文名称：Early Termination Business Type

标识符：1125

说明：提前终止申请业务的分类。

数据类型：文本

取值：进入净额清算、退出净额清算、提前终止

IMIX 域名：无

#### 6.3.74 提前终止申请日期

中文名称：提前终止申请日期

英文名称：Early Termination Application Date

标识符：0822

说明：提前终止的申请日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

#### 6.3.75 提前终止比例

中文名称：提前终止比例

英文名称：Early Termination Ratio

标识符：0823

说明：提前终止的名义本金额占总名义本金额的比例。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.76 提前终止申请方确认状态

中文名称：提前终止申请方确认状态

英文名称：Early Termination Applicant Confirmation Status

标识符：0824

说明：提前终止申请方的确认状态。

数据类型：文本

取值：待确认、已确认

IMIX 域名：无

#### 6.3.77 提前终止申请方确认时间

中文名称：提前终止申请方确认时间

英文名称：Early Termination Applicant Confirmation Time

标识符：0825

说明：提前终止申请方的确认时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：CnfmTime

#### 6.3.78 提前终止申请对手方确认时间



中文名称：提前终止申请对手方确认时间

英文名称：Early Termination Apply Counterparty Confirmation Time

标识符：1147

说明：提前终止申请对手方确认的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：CnfmTime

### 6.3.79 提前终止清算机构处理状态

中文名称：提前终止清算机构处理状态

英文名称：Clearing Institution Process Status of Early Termination

标识符：0826

说明：清算机构对提前终止申请的处理状态。

数据类型：文本

取值：审核通过、审核未通过、已反馈

IMIX 域名：ProcessingStatus

### 6.3.80 提前终止清算机构反馈时间

中文名称：提前终止清算机构反馈时间

英文名称：Clearing Institution Process Feedback Time of Early Termination

标识符：0827

说明：清算机构对提前终止申请的反馈时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TransactTime

### 6.3.81 提前终止状态

中文名称：提前终止状态

英文名称：Early Termination Status

标识符：0828

说明：提前终止的状态。

数据类型：文本

取值：撤销、提前终止失败、未处理、提前终止成功

IMIX 域名：WithdrawRespStatus

### 6.3.82 原成交状态

中文名称：原成交状态

英文名称：Original Deal Status

标识符：0829

说明：终止或撤销交易前的成交状态。

数据类型：文本

取值：正常、应急、撤销、完全提前终止、部分提前终止

IMIX 域名：ExecType

### 6.3.83 终止后成交状态

中文名称：终止后成交状态  
英文名称：Deal Status after Termination  
标识符：0830  
说明：终止后的成交状态。  
数据类型：文本  
取值：全部提前终止  
IMIX 域名：无

### 6.3.84 提交日期

中文名称：提交日期  
英文名称：Submit Date  
标识符：0832  
说明：个性化合约的提交日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.85 提交时间

中文名称：提交时间  
英文名称：Submit Time  
标识符：0833  
说明：个性化合约的提交时间。  
数据类型：时间  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.86 固定利率支付方支付金额

中文名称：固定利率支付方支付金额  
英文名称：Payers of Fixed Pay Amount  
标识符：0834  
说明：个性化合约固定利率支付方的支付金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：LegSettlCurrAmt2

### 6.3.87 浮动利率支付方支付金额

中文名称：浮动利率支付方支付金额  
英文名称：Payers of Floating Pay Amount  
标识符：0835  
说明：个性化合约浮动利率支付方的支付金额。  
数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：LegSettlCurrAmt2

### 6.3.88 个性化合约结算金额提交方式

中文名称：个性化合约结算金额提交方式

英文名称：Personalized Contract Settlement Amount Submit Method

标识符：0836

说明：个性化合约结算金额的提交方式。

数据类型：文本

取值：自行提交、交易系统成交

IMIX 域名：无

### 6.3.89 定息日

中文名称：定息日

英文名称：Fixing Date

标识符：0837

说明：对应货币利率的定息日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.90 支付类型

中文名称：支付类型

英文名称：Payment Type

标识符：0838

说明：会员机构进行资金支付时的不同类型。

数据类型：文本

取值：固定利率、浮动利率1、浮动利率2

IMIX 域名：无

### 6.3.91 定息期天数

中文名称：定息期天数

英文名称：Fixed Rate Period Days

标识符：0839

说明：定息期天数为计息期结束日减去计息期首日，算头不算尾。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.92 付息周期天数

中文名称：付息周期天数

英文名称：Coupon Payment Period Days

标识符：0840

说明：交易双方每隔一段固定的期限会向对方支付换入货币计算的利息金额，该期限即为付息周期。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.93 付息日期

中文名称：付息日期

英文名称：Coupon Payment Date

标识符：0841

说明：支付利息的具体日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CouponPaymentDate或者LegCouponPaymentDate或者UnderlyingCouponPaymentDate

### 6.3.94 首次支付日期

中文名称：首次支付日期

英文名称：First Payment Date

标识符：0842

说明：首次支付的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CouponPaymentDate或者LegCouponPaymentDate

### 6.3.95 平均利率

中文名称：平均利率

英文名称：Average Interest Rate

标识符：0843

说明：一定支付周期内支付利率的平均值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.96 支付周期应付利息

中文名称：支付周期应付利息

英文名称：Payable Interest of Payment Cycle

标识符：0844

说明：支付周期的应付利息。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：AccruedInterestRate

### 6.3.97 支付期本金金额

中文名称：支付期本金金额

英文名称: Capital of Pay Period

标识符: 0845

说明: 支付周期内的本金金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

### 6.3.98 核对状态

中文名称: 核对状态

英文名称: Verification Status

标识符: 0846

说明: 计算代理的核对状态。

数据类型: 文本

取值: 核对通过、未核对、核对有异议

IMIX 域名: 无

### 6.3.99 核对结果

中文名称: 核对结果

英文名称: Verification Result

标识符: 0847

说明: 计算代理的核对结果。

数据类型: 文本

取值: 核对未完成、双方不一致、双方一致、场务确认

IMIX 域名: 无

### 6.3.100 异议金额

中文名称: 异议金额

英文名称: Dissent Amount

标识符: 0848

说明: 双方核对中出现不一致的金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

### 6.3.101 重置期首日

中文名称: 重置期首日

英文名称: Reset Period on the First Date

标识符: 0849

说明: 重置利率的第一天。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: 无

### 6.3.102 重置期结束日

中文名称：重置期结束日  
英文名称：Reset Period End Date  
标识符：0850  
说明：结束重置利率的日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.103 重置期天数

中文名称：重置期天数  
英文名称：Reset Period Days  
标识符：0851  
说明：重置期天数为重置期结束日减去重置期首日，算头不算尾。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.104 重置日确定日期

中文名称：重置日确定日期  
英文名称：Determined Date of the Reset Date  
标识符：0852  
说明：确定利率重置的日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.105 重置利率

中文名称：重置利率  
英文名称：Reset Interest Rate  
标识符：0853  
说明：重置后计算利息的利率。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.106 重置期当期本金

中文名称：重置期当期本金  
英文名称：Current Capital on Reset Period  
标识符：0854  
说明：利率重置期间的本金金额。  
数据类型：数值

取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.107 重置期当期利息

中文名称：重置期当期利息  
英文名称：Current Interest on Reset Period  
标识符：0855  
说明：利率重置期间的利息。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.108 残段结束日

中文名称：残段结束日  
英文名称：Stub End Date  
标识符：0030  
说明：利率互换中不完整计息期的结束日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.109 前后端残段标识

中文名称：前后端残段标识  
英文名称：Stub Indicator  
标识符：0251  
说明：标注利率互换交易是否存在前端或后端残段。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：StubIndicator

#### 6.3.110 残段利息

中文名称：残段利息  
英文名称：Stub Interest Amount  
标识符：0033  
说明：利率互换中不完整计息期的利息。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.3.111 残段支付日

中文名称：残段支付日  
英文名称：Stub Interest Payment Date  
标识符：0031

说明：利率互换中不完整计息期利息的支付日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.112 残段起始日

中文名称：残段起始日

英文名称：Stub Start Date

标识符：0029

说明：利率互换中不完整计息期的起始日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.3.113 交谈历史记录数

中文名称：交谈历史记录数

英文名称：Negotiation Count

标识符：0275

说明：交易过程中交谈历史记录数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：NegotiationCount

#### 6.3.114 意向报价会话类型

中文名称：意向报价会话类型

英文名称：Indicative Transaction Type

标识符：0338

说明：对意向报价进行的操作的类型。

数据类型：文本

取值：新增、撤销、修改

IMIX 域名：IOITransType

#### 6.3.115 场次日期

中文名称：场次日期

英文名称：Deal Date

标识符：0438

说明：24小时交易中当前场次开市的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：DateConfirmed

#### 6.3.116 发送范围类型

中文名称：发送范围类型



英文名称: Routing Type

标识符: 0386

说明: 标注报价的发送范围是全部交易成员还是部分成员。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: RoutingType

### 6.3.117 冲销方式

中文名称: 冲销方式

英文名称: Writeoff Method

标识符: 1114

说明: 会员机构资金冲销的方法。

数据类型: 文本

取值: 多边冲销、双边冲销

IMIX 域名: WriteOffMethod

### 6.3.118 申购状态

中文名称: 申购状态

英文名称: Subscription Status

标识符: 1124

说明: 用于表示申购的状态, 分为未申购和已申购。

数据类型: 文本

取值: 未申购、已申购

IMIX 域名: 无

### 6.3.119 订单状态

中文名称: 订单状态

英文名称: Order Status

标识符: 0178

说明: 交易员创建的订单在不同阶段所处的状态。

数据类型: 文本

取值: 正常、部分成交、全部成交、待成交、撤销、修改、停止、过期、拒绝

IMIX 域名: OrdStatus

### 6.3.120 回价持续有效时间

中文名称: 回价持续有效时间

英文名称: Price Sustained Effective Time

标识符: 1140

说明: 回价方回复价格的持续时间, 回价有效的时间段。

数据类型: 时间

取值: 无

IMIX 域名: 无

### 6.3.121 折算率

中文名称：折算率

英文名称：Conversion Rate

标识符：1141

说明：基准货币或非基准货币对美元的折算率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.122 非标准交易补充信息

中文名称：非标准交易补充信息

英文名称：Non Standard Transaction Supplementary Information

标识符：1142

说明：货币掉期产品交易中，交易发起方可填写的补充协议。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Text

### 6.3.123 原清算状态

中文名称：原清算状态

英文名称：Original Clearing Status

标识符：1146

说明：用于标识变更前的成交交易是否已清算。

数据类型：文本

取值：承接、待承接、未承接

IMIX 域名：无

### 6.3.124 成交方式

中文名称：成交方式

英文名称：Deal Method

标识符：1216

说明：标识买卖双方达成交易的方式。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.125 本方异议金额

中文名称：本方异议金额

英文名称：Party Dissent Amount

标识符：1153

说明：双方核对中出现的本方不一致的金额。

数据类型：数值

取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.126 对手方异议金额

中文名称：对手方异议金额  
英文名称：Counterparty Dissent Amount  
标识符：1154  
说明：双方核对中出现的对手方不一致的金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.127 重置期 ID

中文名称：重置期ID  
英文名称：Reset Period ID  
标识符：1156  
说明：用于描述一笔交易中不同重置期生成的编号，用来标识各重置期内的现金流明细。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.128 利差上限

中文名称：利差上限  
英文名称：Spread Upper Limit  
标识符：1192  
说明：系统设置的能输入的最大利差值，超过此利差值，系统给出相应提示信息。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.129 利差下限

中文名称：利差下限  
英文名称：Spread Lower Limit  
标识符：1193  
说明：系统设置的能输入的最小利差值，低于此利差值，系统给出相应提示信息。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

### 6.3.130 结算状态

中文名称：结算状态  
英文名称：Settlement Status  
标识符：1195

说明：用于标识一笔交易（包含备案交易）的结算信息的不同情况。

数据类型：文本

取值：未结算、已结算

IMIX 域名：SettlementStatus

### 6.3.131 备案方式

中文名称：备案方式

英文名称：Recorded Deal Method

标识符：1196

说明：用于记录备案信息上传至系统的方式。

数据类型：文本

取值：手动添加、文件上传、API上传

IMIX 域名：无

### 6.3.132 合约价格

中文名称：合约价格

英文名称：Contract Price

标识符：1198

说明：用于记录特定产品的合约价格信息。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.3.133 盘中参考价

中文名称：盘中参考价

英文名称：Intraday Reference Price

标识符：1199

说明：与报价点差限制结合，作为用户进行有效报价的依据。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示盘中参考价）

### 6.3.134 标准债券远期交割方式

中文名称：标准债券远期交割方式

英文名称：Standard Bond Forward Delivery Method

标识符：1200

说明：用于描述标准债券远期成交的交割方法。

数据类型：文本

取值：实物交割、现金交割

IMIX 域名：DeliveryForm

### 6.3.135 合约名称

中文名称：合约名称

英文名称：Contract Name

标识符：1201

说明：用于描述特定产品中合约标的的名称，如标准债券远期产品中的“3年期国债远期合约”。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Symbol或者SecurityID 或者LegSecurityID

### 6.3.136 转换因子

中文名称：转换因子

英文名称：Conversion Factor

标识符：1202

说明：以合约对应虚拟债券的票面利率作为到期收益率，计算出的单位面值可交割债券的到期交割日净价。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Factor

### 6.3.137 每日结算利率

中文名称：每日结算利率

英文名称：Daily Settlement Rate

标识符：1203

说明：根据一定规则计算出的各合约的每日结算利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MDEntryPx（JR/T 0066一般以“MarketData”组件中的Type域和Px域组合表示每日结算利率）

### 6.3.138 到期结算利率

中文名称：到期结算利率

英文名称：Settlement Rate to Maturity

标识符：1204

说明：根据一定规则计算出的各合约的到期结算利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

## 6.4 公共数据

### 6.4.1 生效日

中文名称：生效日

英文名称：Effective Date

标识符：0521

说明：某项业务、数据或功能在系统中可使用的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：StartDate或者TransactTime

#### 6.4.2 备注

中文名称：备注

英文名称：Remark

标识符：0303

说明：关于其他情况的说明。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Text

#### 6.4.3 参考利率/基准利率名称

中文名称：参考利率/基准利率名称

英文名称：Reference Rate/Benchmark Interest Rate

标识符：0374

说明：市场上具有普遍参照作用的利率，其他利率水平或金融资产价格均可根据这一基准利率水平来确定，交易双方约定用来确定浮动利率水平的利率指标。

数据类型：文本

取值：人民币活期存款利率、人民币三个月定期存款利率、人民币半年定期存款利率、人民币一年定期存款利率、人民币二年定期存款利率、人民币三年定期存款利率、人民币五年定期存款利率、人民币六个月贷款利率、人民币一年贷款利率、人民币三至五年贷款利率、人民币五年以上贷款利率、人民币一至三年贷款利率、人民币五年以下（含五年）个人住房公积金贷款利率、人民币五年以上个人住房公积金贷款利率、Shibor0/N、Shibor1W、Shibor2W、Shibor1M、Shibor3M、Shibor6M、Shibor9M、Shibor1Y、隔夜回购定盘利率（FR001）、7天回购定盘利率（FR007）、14天回购定盘利率（FR014）、Libor 0/N、Libor 1W、Libor 2W、Libor 1M、Libor 2M、Libor 3M、Libor 4M、Libor 5M、Libor 6M、Libor 7M、Libor 8M、Libor 9M、Libor 10M、Libor 11M、Libor 1Y、Hibor 0/N、Hibor 1W、Hibor 2W、Hibor 1M、Hibor 2M、Hibor 3M、Hibor 4M、Hibor 5M、Hibor 6M、Hibor 7M、Hibor 8M、Hibor 9M、Hibor 10M、Hibor 11M、Hibor 1Y、Euribor 0/N、Euribor 1W、Euribor 2W、Euribor 3W、Euribor 1M、Euribor 2M、Euribor 3M、Euribor 4M、Euribor 5M、Euribor 6M、Euribor 7M、Euribor 8M、Euribor 9M、Euribor 10M、Euribor 11M、Euribor 1Y、B\_1W、B1W、B\_2W、B2W、B\_3W、B3W、B\_1M、B1M、B\_2M、B2M、B\_3M、B3M、B\_4M、B4M、B\_5M、B5M、B\_6M、B6M、B\_7M、B7M、B\_8M、B8M、B\_9M、B9M、B\_10M、B10M、B\_11M、B11M、B\_12M、B12M、SCP曲线\_0.25年、SCP曲线\_0.5年、SCP曲线\_0.75年

IMIX 域名：BenchmarkCurveName或者LegBenchmarkCurveName

#### 6.4.4 到期日

中文名称：到期日

英文名称：Maturity Date

标识符：0232

说明：不同业务场景下到期日含义不同，具体如下：

- a) 证券本金偿还结束日或票据、存单等交易标的到期偿付日；

- b) 一笔衍生产品交易结束的日期;
- c) 货币掉期中指期末本金交换日和最后一次利息交换日;
- d) 期权中指期权买方选择是否行权的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: MaturityDate或者EndDate或者SettleDate

#### 6.4.5 计算方法

中文名称: 计算方法

英文名称: Calculation Method

标识符: 0177

说明: 即利息分配方式。债券或其他证券利息或收益率的计算规则。

数据类型: 文本

取值: 天数、频率

IMIX 域名: InterstAllocationMethod

#### 6.4.6 计算机构

中文名称: 计算机构

英文名称: Calculation Agency

标识符: 0645

说明: 就一笔交易而言, 交易双方约定的负责对支付义务进行具体计算的机构。

数据类型: 文本

取值: 中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心、交易双方、买入方、卖出方

IMIX 域名: CalculateAgency

#### 6.4.7 交易工具类型

中文名称: 交易工具类型

英文名称: Transaction Tools Type

标识符: 0900

说明: 用于交易的核心标的物, 一般为金融资产。

数据类型: 文本

取值: 债券、预发行债券、信用风险缓释凭证、货币对

IMIX 域名: ProductComplex

#### 6.4.8 债券类型

中文名称: 债券类型

英文名称: Bond Type

标识符: 0203

说明: 债券的细分种类。

数据类型: 文本

取值: 国债、央行票据、政策性金融债、企业债、次级债、短期融资券、商业银行普通金融债、国际开发机构债、混合资本债、中期票据、地方政府债、财务公司债、证券公司债、证券公司短期融资券、

集合票据、金融租赁公司金融债、政府支持机构债券、汽车金融公司金融债、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、政府支持债券、资产支持证券

IMIX 域名: SecurityType或者UnderlyingSecurityType

#### 6.4.9 债券代码

中文名称: 债券代码

英文名称: Bond Code

标识符: 0499

说明: 债券流通托管机构公布的债券代码。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: SecurityID或者UnderlyingSecurityID或者LegSecurityID

#### 6.4.10 债券名称

中文名称: 债券名称

英文名称: Bond Name

标识符: 0501

说明: 债券的名称, 在债券募集说明书或者流通要素公告中公布的债券名称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: UnderlyingSymbol或者Symbol

#### 6.4.11 债券简称

中文名称: 债券简称

英文名称: Bond Short Name

标识符: 0901

说明: 债券的简称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: Symbol

#### 6.4.12 债券全称

中文名称: 债券全称

英文名称: Bond Full Name

标识符: 0902

说明: 债券发行时的全称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: FullSymbol

#### 6.4.13 ISIN 编码

中文名称: ISIN编码

英文名称: ISIN Code



标识符：0903

说明：我国的ISIN编码，按照GB/T 21076—2017规定，ISIN编码为唯一地识别给定证券或其他金融工具的代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.14 货币网债券全称

中文名称：货币网债券全称

英文名称：Chinamoney Bonds Full Name

标识符：0904

说明：债券在货币网中展示的全称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：FullSymbol

#### 6.4.15 证券代码

中文名称：证券代码

英文名称：Security Code

标识符：0905

说明：标识资产支持证券的唯一代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID

#### 6.4.16 证券名称

中文名称：证券名称

英文名称：Security Name

标识符：0906

说明：资产支持证券的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Symbol或者MarginSymbol

#### 6.4.17 凭证代码

中文名称：凭证代码

英文名称：Voucher Code

标识符：0908

说明：标识信用风险缓释凭证的唯一代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID

#### 6.4.18 凭证简称

中文名称：凭证简称  
英文名称：Voucher Short Name  
标识符：0909  
说明：信用风险缓释凭证的简称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：Symbol

#### 6.4.19 凭证名称

中文名称：凭证名称  
英文名称：Voucher Name  
标识符：0910  
说明：信用风险缓释凭证的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：Symbol

#### 6.4.20 货币对名称

中文名称：货币对名称  
英文名称：Currency Pair Name  
标识符：0123  
说明：人民币对、外币对及贵金属货币对的名称。  
数据类型：文本  
取值：美元/人民币（USD/CNY）、日元/人民币（100JPY/CNY）、港币/人民币（HKD/CNY）、欧元/人民币（EUR/CNY）、英镑/人民币（GBP/CNY）、澳元/人民币（AUD/CNY）、加元/人民币（CAD/CNY）、人民币/林吉特（CNY/MRY）、人民币/卢布（CNY/RUB）、人民币/泰铢（CNY/THB）、欧元/美元（EUR/USD）、英镑/美元（GBP/USD）、美元/日元（USD/JPY）、美元/加元（USD/CAD）、美元/瑞士法郎（USD/CHF）、澳元/美元（AUD/USD）、美元/港币（USD/HKD）、欧元/日元（EUR/JPY）、美元/新加坡元（USD/SGD）  
IMIX 域名：Symbol

#### 6.4.21 基准货币

中文名称：基准货币  
英文名称：Base Currency  
标识符：0451  
说明：货币代码，按照GB/T 12406规定，一个货币对中作为被计价标的的货币。  
数据类型：文本  
取值：美元（USD）、日元（JPY）、港币（HKD）、欧元（EUR）、英镑（GBP）、澳元（AUD）、加元（CAD）、人民币（CNY）  
IMIX 域名：Currency1

#### 6.4.22 非基准货币

中文名称：非基准货币

英文名称：Term Currency/Quote Currency

标识符：0912

说明：货币代码，按照GB/T 12406规定，一个货币对中用于计量一个货币单位基准货币价格的货币，也称计价货币或相对货币。

数据类型：文本

取值：人民币（CNY）、林吉特（MRY）、卢布（RUB）、泰铢（THB）、美元（USD）、日元（JPY）、加元（CAD）、瑞士法郎（CHF）、港币（HKD）、新加坡元（SGC）

IMIX 域名：Currency2

#### 6.4.23 发行量

中文名称：发行量

英文名称：Issue Size

标识符：0382

说明：债券或其他证券的发行数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssueSize或者PosAmt

#### 6.4.24 流通量

中文名称：流通量

英文名称：Circulation Size

标识符：0152

说明：债券或其他证券上市流通总量，如果有增发的情况，将更新。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：CirculationSize

#### 6.4.25 当前流通总量

中文名称：当前流通总量

英文名称：Current Circulation Total Size

标识符：0914

说明：债券或其他证券当前在市场上的流通总量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：CirculationSize

#### 6.4.26 面值

中文名称：面值

英文名称：Face Value

标识符：0107

说明：债券的票面价值，是发行人对债券持有人在债券到期后应偿还的本金数额，也是企业向债券持有人按期支付利息的计算依据。债券的面值与债券实际的发行价格并不一定是一致的，发行价格大于面值称为溢价发行，等于面值称为平价发行，小于面值称为折价发行。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：FaceValue

#### 6.4.27 发行价格

中文名称：发行价格

英文名称：Issue Price

标识符：0379

说明：债券、证券、存单等交易标的的出售价格或购买价格。发行价格不一定是票面值，它可低于或高于票面值发行，按照债券发行价格与其票面值的关系，可分为平价发行、折价发行和溢价发行三种发行价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssuePx

#### 6.4.28 发行日期

中文名称：发行日期

英文名称：Issue Date

标识符：0376

说明：即发行起始日。债券或其他证券发行的日期，从该日期开始计算利息。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：IssueDate

#### 6.4.29 上市交易日

中文名称：上市交易日

英文名称：Launch Date

标识符：0256

说明：募集说明书中提到的债券在银行间市场的上市交易日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ListDate

#### 6.4.30 摘牌日

中文名称：摘牌日

英文名称：Delisting Date

标识符：0915

说明：债券或其他证券在银行间市场的流通终止日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名: DelistDate

#### 6.4.31 交易工具状态

中文名称: 交易工具状态

英文名称: Trading Tools Status

标识符: 0916

说明: 债券或其他证券在市场中所处的状态。

数据类型: 文本

取值: 待处理、活动、非活动、禁用、摘牌

IMIX 域名: 无

#### 6.4.32 债券期限

中文名称: 债券期限

英文名称: Bond Term

标识符: 0917

说明: 在债券发行时就确定的债券还本的年限, 债券的发行人到期应偿还本金。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: SecurityTerm或者SecurityTermString

#### 6.4.33 托管机构

中文名称: 托管机构

英文名称: Custodian

标识符: 0353

说明: 为客户托管债券/证券的银行或者其他金融机构。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: PartySubID (JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体, 以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息, 托管机构由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示)

#### 6.4.34 是否适用净额清算

中文名称: 是否适用净额清算

英文名称: Net Settlement Indicator

标识符: 0918

说明: 债券的交易是否可在清算机构进行净额清算。

数据类型: 文本

取值: 是、否

IMIX 域名: 无

#### 6.4.35 评级类型

中文名称: 评级类型

英文名称: Credit Rating Type

标识符: 0919

说明：债券（证券、凭证）的评级分类。

数据类型：文本

取值：主体评级、债券评级、标的实体评级、标的债务评级

IMIX 域名：CreditRatingType

#### 6.4.36 主体评级

中文名称：主体评级

英文名称：Subject Rating

标识符：0920

说明：以企业、经济主体为对象进行的信用评级，包含创设机构主体评级等。

数据类型：文本

取值：AAA、AA+、AA、AA-、A+、A、A-、BBB+、BBB、BBB-、BB+、BB、BB-、B+、B、B-、CCC、CC、

C

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.37 评级生效日

中文名称：评级生效日

英文名称：Rating Effective Date

标识符：0921

说明：信用评级的开始日期，适用于标的实体（主体、创设机构）和标的债务。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityFrom

#### 6.4.38 评级截止日

中文名称：评级截止日

英文名称：Rating Deadline

标识符：0922

说明：记录评级报告的截止日期，适用于标的实体（主体、创设机构）和标的债务。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityTo

#### 6.4.39 评级公司/信用评级机构

中文名称：评级公司/信用评级机构

英文名称：Rating Corporation/Credit Rating Institution

标识符：0923

说明：依法设立的从事信用评级业务的社会中介机构，由专门的经济、法律、财务专家组成的对证券发行人和证券信用进行等级评定的组织。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRatingAgency

#### 6.4.40 债项评级

中文名称：债项评级

英文名称：Debt Rating

标识符：0924

说明：以企业或经济主体发行的有价债券或标的债务等为对象进行的信用评级。

数据类型：文本

取值：AAA、AA+、AA、AA-、A+、A、A-、BBB+、BBB、BBB-、BB+、BB、BB-、B+、B、B-、CCC、CC、C、A-1、A-2、A-3、D

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.41 创设机构主体评级

中文名称：创设机构主体评级

英文名称：Originators Main Rating

标识符：0925

说明：信用风险缓释凭证创设机构的信用评级。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.42 创设机构评级展望

中文名称：创设机构评级展望

英文名称：Originators Rating Outlook

标识符：0926

说明：评级公司针对信用风险缓释凭证创设机构未来信用状况走向的预测。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.43 创设机构评级生效日

中文名称：创设机构评级生效日

英文名称：Originators Rating Effective Date

标识符：0927

说明：信用风险缓释凭证创设机构信用评级的开始日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityFrom

#### 6.4.44 创设机构评级截止日

中文名称：创设机构评级截止日

英文名称：Origitnators Rating Deadline

标识符：0928

说明：信用风险缓释凭证创设机构记录评级报告的截止日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityTo

#### 6.4.45 创设机构评级公司

中文名称：创设机构评级公司

英文名称：Originators Rating Corporation

标识符：0929

说明：对信用风险缓释凭证创设机构的资信进行等级评定的专业组织机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRatingAgency

#### 6.4.46 标的实体主体评级

中文名称：标的实体主体评级

英文名称：Underlying Entity Main Rating

标识符：0930

说明：信用风险缓释凭证债务相关机构的信用评级。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.47 标的实体评级展望

中文名称：标的实体评级展望

英文名称：Underlying Entity Rating Outlook

标识符：0931

说明：评级公司针对信用风险缓释凭证债务机构未来信用状况走向的预测。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.48 标的实体评级生效日

中文名称：标的实体评级生效日

英文名称：Underlying Entity Rating Effective Date

标识符：0932

说明：信用风险缓释凭证债务机构信用评级的开始日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityFrom

#### 6.4.49 标的实体评级截止日

中文名称：标的实体评级截止日

英文名称：Underlying Entity Rating Deadline



标识符：0933

说明：信用风险缓释凭证债务机构记录评级报告的截止日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityTo

#### 6.4.50 标的实体评级公司

中文名称：标的实体评级公司

英文名称：Underlying Entity Rating Corporation

标识符：0934

说明：对信用风险缓释凭证债务机构的资信进行等级评定的专业组织机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRatingAgency

#### 6.4.51 标的债务主体评级

中文名称：标的债务主体评级

英文名称：Underlying Debt Main Rating

标识符：0935

说明：信用风险缓释凭证目标债务的信用评级。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.52 标的债务评级展望

中文名称：标的债务评级展望

英文名称：Underlying Debt Rating Outlook

标识符：0936

说明：评级公司针对信用风险缓释凭证目标债务未来信用状况走向的预测。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.53 标的债务评级生效日

中文名称：标的债务评级生效日

英文名称：Underlying Debt Rating Effective Date

标识符：0937

说明：信用风险缓释凭证目标债务信用评级的开始日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityFrom

#### 6.4.54 标的债务评级截止日

中文名称：标的债务评级截止日

英文名称：Underlying Debt Rating Deadline

标识符：0938

说明：信用风险缓释凭证目标债务记录评级报告的截止日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CreditValidityTo

#### 6.4.55 标的债务评级公司

中文名称：标的债务评级公司

英文名称：Underlying Debt Rating Corporation

标识符：0939

说明：对信用风险缓释凭证目标债务的资信进行等级评定的专业组织机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRatingAgency

#### 6.4.56 息票类型

中文名称：息票类型

英文名称：Coupon Type

标识符：0940

说明：债券付息方式分类。

数据类型：文本

取值：付息式固定利率、付息式浮动利率、零息式、贴现式

IMIX 域名：CouponRateType

#### 6.4.57 付息频率

中文名称：付息频率

英文名称：Coupon Frequency

标识符：0941

说明：该债券每年支付利息的次数。

数据类型：文本

取值：月、季、半年、年、其他

IMIX 域名：CouponPaymentFrequency或者LegCouponPaymentFrequency

#### 6.4.58 首次付息日

中文名称：首次付息日

英文名称：First Coupon Payment Date

标识符：0942

说明：第一次支付利息的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CouponPaymentDate或者CouponPaymentDate

#### 6.4.59 票面利率

中文名称：票面利率

英文名称：Coupon Rate

标识符：0192

说明：债券利息与债券面值的比率，是发行人承诺以后一定时期支付给债券持有人报酬的计算标准。债券票面利率的确定主要受到银行利率、发行者的资信状况、偿还期限和利息计算方法以及当时资金市场上资金供求情况等因素的影响。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：CouponRate或者UnderlyingCouponRate

#### 6.4.60 基准利率参考日

中文名称：基准利率参考日

英文名称：Benchmark Interest Rate Reference Date

标识符：0943

说明：选取基准利率的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：InterestFixDate或者LegInterestAccrualDate

#### 6.4.61 基准利差

中文名称：基准利差

英文名称：Benchmark Spread Rate

标识符：0944

说明：用于浮动利率债，在基准利率基础上加上基准利差，用来确定浮动利率债的最终利率值。基准利差取值可正可负。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Spread

#### 6.4.62 首次基准利率

中文名称：首次基准利率

英文名称：First Benchmark Rate

标识符：0945

说明：发行机构首次添加的基准利率，用于计算首次利息支付。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice

#### 6.4.63 当前基准利率

中文名称：当前基准利率

英文名称：Current Benchmark Rate

标识符：0946

说明：当前计息周期内使用的基准利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice

#### 6.4.64 参照基准的浮动利率

中文名称：参照基准的浮动利率

英文名称：Reference Benchmark Floating Rate

标识符：0947

说明：资产支持证券参照基准利率的浮动利率。计算公式为：参照基准的浮动利率=当前基准利率+基本利差，当计算结果大于利率上限时取利率上限，当计算结果小于利率下限时取利率下限。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice

#### 6.4.65 当前利率

中文名称：当前利率

英文名称：Current Interest Rate

标识符：0948

说明：浮动债券当前的利率。计算公式为：“当前利率=基准利率值+基准利差”或“当前利率=首次基准利率+基准利差”，当计算结果大于利率上限时取利率上限，当计算结果小于利率下限时取利率下限。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice

#### 6.4.66 基准利率确定日

中文名称：基准利率确定日

英文名称：Benchmark Rate Fixing Date

标识符：0949

说明：确定基准利率的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：InterestAccrualDate

#### 6.4.67 基准重置天数计算方法

中文名称：基准重置天数计算方法

英文名称：Calculation Method of Benchmark Reset Days

标识符：0950

说明：基准重置天数的计算方法。

数据类型：文本

取值：日历日、工作日

IMIX 域名：无

#### 6.4.68 基准利率生效日

中文名称：基准利率生效日

英文名称：Benchmark Rate Effective Date

标识符：0951

说明：基准利率开始生效的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkEffectiveDate

#### 6.4.69 基准利率类型

中文名称：基准利率类型

英文名称：Benchmark Rate Type

标识符：0952

说明：中国人民银行公布的商业银行存贷款等业务的指导性利率类型。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.70 利率上限

中文名称：利率上限

英文名称：Cap Rate

标识符：0213

说明：浮息债的最高票面利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.71 利率下限

中文名称：利率下限

英文名称：Floor Rate

标识符：0212

说明：浮息债的最低票面利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.72 当前每百元本金

中文名称：当前每百元本金

英文名称：Current Principal Amount Per 100 Yuan

标识符：0953

说明：当前利息支付期内每百元券面总额的本金。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Principal

#### 6.4.73 含权类型

中文名称：含权类型

英文名称：Option-Embedded Type

标识符：0954

说明：债券中所包含的不同权利的分类。相对于行权类型，静态描述含权信息。

数据类型：文本

取值：发行人赎回权、投资人回售选择权、发行人调整票面利率选择权、发行人合并债券选择权、投资人暂停索偿和发行人利率递延权、投资人定向转让选择权、其他选择权、提前还本

IMIX 域名：无

#### 6.4.74 行权量

中文名称：行权量

英文名称：Exercise Amount

标识符：0955

说明：发行人发行权证时所约定的，权证持有人向发行人购买或出售标的证券的数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.75 行权后利率/基准利差

中文名称：行权后利率/基准利差

英文名称：Interest Rate after Exercise/Benchmark Interest Rate Spreads

标识符：0956

说明：根据行权类型行使选择权后债券的利率。若为固定收益债券，则对应行权后利率值；若为浮动利率债券，则对应基准利差值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Spread

#### 6.4.76 可转债类型

中文名称：可转债类型

英文名称：Conversion Bond Type

标识符：0957

说明：可转换成其他证券的类型，包含部分转债和全部转债。

数据类型：文本

取值：部分、全部

IMIX 域名：无

#### 6.4.77 转换比例

中文名称：转换比例

英文名称：Conversion Percentage

标识符：0958

说明：转换比例不同场景下具有不同含义。具体包含以下三种解释：

- a) 约定的可转换比例；
- b) 赎回部分占面值的百分比；
- c) 一定面额可转换债券可转换成普通股票的股数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.78 转换价格

中文名称：转换价格

英文名称：Conversion Price

标识符：0102

说明：约定的转换价格或转换后的股票价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.79 转换日期

中文名称：转换日期

英文名称：Conversion Date

标识符：0103

说明：可转债约定的转换为股票的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.80 续发日期

中文名称：续发日期

英文名称：Secondary Date

标识符：0959

说明：债券或其他证券再次发行的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ReissueDate

#### 6.4.81 计划增发量

中文名称：计划增发量

英文名称：Planned Reissuance Quantity

标识符：0960

说明：债券或其他证券再次发行时的计划发行量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.82 实际续发量

中文名称：实际续发量

英文名称：Actual Secondary Quantity

标识符：0961

说明：债券或其他证券再次发行时的实际发行量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：ReissueSize

#### 6.4.83 提前还本日期

中文名称：提前还本日期

英文名称：Prepayment Date

标识符：0962

说明：债券提前还本的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：RedemptionDate

#### 6.4.84 提前还本金额

中文名称：提前还本金额

英文名称：Prepayment Amount

标识符：0963

说明：债券提前还本的金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RedemptionOfFaceValue

#### 6.4.85 初始投资人数量

中文名称：初始投资人数量

英文名称：Number of Initial Investors

标识符：0964

说明：定向工具发行的初始投资人数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.86 投资人范围

中文名称：投资人范围

英文名称：Investors Range



标识符：0965

说明：定向工具的投资人范围。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartyDetailAltSubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，投资人范围由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.4.87 停牌起始日

中文名称：停牌起始日

英文名称：Suspended Start Date

标识符：0198

说明：债券或其他证券暂停交易的起始日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.88 停牌终止日

中文名称：停牌终止日

英文名称：Suspended End Date

标识符：0197

说明：债券或其他证券暂停交易的终止日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.89 停牌原因

中文名称：停牌原因

英文名称：Suspended Reason

标识符：0200

说明：债券或其他证券暂停交易的原因。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.90 摘牌日期（交易所）

中文名称：摘牌日期（交易所）

英文名称：Delisting Date（Exchange）

标识符：0966

说明：债券在交易所摘牌，停止进行交易的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：DelistDate

#### 6.4.91 发行人昵称

中文名称：发行人昵称  
英文名称：Issuer Nickname  
标识符：0967  
说明：集合类债券发行人的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.92 发行人全称

中文名称：发行人全称  
英文名称：Issuer Full Name  
标识符：0968  
说明：证券发行人经过相关权威部门审核准许使用的具有法律效力的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，发行人全称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.4.93 发行额度

中文名称：发行额度  
英文名称：Issue Amount  
标识符：0969  
说明：发行债券、证券、存单等交易标的的面值总额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.94 发行类型

中文名称：发行类型  
英文名称：Issue Type  
标识符：0970  
说明：预发行市场独有，类型包括新发、续发。  
数据类型：文本  
取值：新发、续发  
IMIX 域名：无

#### 6.4.95 计划发行量

中文名称：计划发行量  
英文名称：Planned Circulation  
标识符：0971  
说明：债券、证券、大额存单等交易标的的正式招标之前计划发行的数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssueSizeForPlan

#### 6.4.96 实际发行量

中文名称：实际发行量

英文名称：Actual Circulation

标识符：0972

说明：债券正式招标之后实际发行的债券量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssueSize

#### 6.4.97 首发价格

中文名称：首发价格

英文名称：First Starting Price

标识符：0973

说明：发行类型为续发的债券新发时的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssuePx

#### 6.4.98 招标日

中文名称：招标日

英文名称：Tendering Date

标识符：0974

说明：债券发行过程中的招标日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和Date域组合表示招标日）

#### 6.4.99 缴款日

中文名称：缴款日

英文名称：Payment Date

标识符：0975

说明：债券发行过程中的机构缴款日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和Date域组合表示缴款日）

#### 6.4.100 上市流通日

中文名称：上市流通日

英文名称：Listing Date

标识符：1214

说明：债券或其他证券正式发行后在市场上交易的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ListDate

#### 6.4.101 预发行开始日

中文名称：预发行开始日

英文名称：Prerelease Start Date

标识符：0976

说明：预发行债券的开始日期，为起息日后第一个工作日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.102 预发行结束日

中文名称：预发行结束日

英文名称：Prerelease End Date

标识符：0977

说明：预发行债券的结束日期，为起息日后第四个工作日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.103 净卖出总限额

中文名称：净卖出总限额

英文名称：Total Limit Amount of Net Sell

标识符：0978

说明：净卖出总限额是对卖出减去买入的额度控制，当卖出减去买入超过该额度值就不能再卖出。净卖出总限额的计算公式为：净卖出总限额=发行量（或计划发行量）×净卖出总限额百分比，净卖出总限额百分比可人工配置。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.104 预期到期日

中文名称：预期到期日

英文名称：Expected Maturity Date

标识符：0979

说明：按照计划向投资者偿付本金的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ExpectedMaturityDate

#### 6.4.105 法定到期日

中文名称：法定到期日  
英文名称：Legal Maturity Date  
标识符：0980  
说明：应向投资者偿付本金的日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：LegalMaturityDate

#### 6.4.106 实际到期日

中文名称：实际到期日  
英文名称：Actual Maturity Date  
标识符：0317  
说明：实际的证券到期日。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：ActualMaturityDate

#### 6.4.107 证券期限

中文名称：证券期限  
英文名称：Security Terms  
标识符：0115  
说明：发行日至预期到期日的期限，若无预期到期日，则为发行日至法定到期日的期限。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：SecurityTerm

#### 6.4.108 初始每百元本金额

中文名称：初始每百元本金额  
英文名称：Initial Principal Amount Per 100 Yuan  
标识符：0981  
说明：资产支持证券发行时的票面金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：Principal

#### 6.4.109 当前每百元本金额

中文名称：当前每百元本金额  
英文名称：Current Principal Amount Per 100 Yuan  
标识符：0982  
说明：资产支持证券当前付息周期内的票面金额。  
数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Principal

#### 6.4.110 下一每百元本金额

中文名称：下一每百元本金额

英文名称：Next Principal Amount Per 100 Yuan

标识符：0983

说明：下一周期的票面金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：Principal

#### 6.4.111 资产支持证券当前流通总量

中文名称：资产支持证券当前流通总量

英文名称：ABS Current Circulation Size

标识符：0984

说明：资产支持证券当前的流通总量，资产支持证券当前流通总量的计算公式为：资产支持证券当前流通总量=当前每百元本金额×流通总量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：CirculationSize

#### 6.4.112 本金支付频率

中文名称：本金支付频率

英文名称：Principal Payment Frequency

标识符：0010

说明：资产支持证券支付本金的时间周期。

数据类型：文本

取值：月、季、半年、年、到期

IMIX 域名：PrincipalPayFrequency

#### 6.4.113 首次本金支付日

中文名称：首次本金支付日

英文名称：First Coupon Payment Date

标识符：1215

说明：资产支持证券第一次支付本金的日期。

应满足以下三个条件：

a) 晚于发行日期；

b) 晚于上市交易日；

c) 早于摘牌日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：PaymentDate

**6.4.114 当前资产池收益率**

中文名称：当前资产池收益率  
 英文名称：Current Asset Pool Yield  
 标识符：0985  
 说明：资产支持证券当前阶段的资产池收益率。  
 数据类型：数值  
 取值：无  
 IMIX 域名：无

**6.4.115 下一资产池收益率**

中文名称：下一资产池收益率  
 英文名称：Next Asset Pool Yield  
 标识符：0986  
 说明：资产支持证券下一周期的资产池收益率。  
 数据类型：数值  
 取值：无  
 IMIX 域名：StipulationValue（JR/T 0066一般以“Stipulation”组件中的Type域和Value域组合表示下一资产池收益率）

**6.4.116 标的实体**

中文名称：标的实体  
 英文名称：Underlying Entity  
 标识符：0987  
 说明：与信用风险缓释凭证标的债务有关的实体。  
 数据类型：文本  
 取值：无  
 IMIX 域名：UnderlyingIssuer

**6.4.117 标的债务**

中文名称：标的债务  
 英文名称：Underlying Debt  
 标识符：0988  
 说明：信用风险缓释凭证的目标债务。  
 数据类型：文本  
 取值：无  
 IMIX 域名：UnderlyingSecurityID

**6.4.118 标的债务流通总量**

中文名称：标的债务流通总量  
 英文名称：Underlying Debt Circulation Size  
 标识符：0989  
 说明：标的债务的上市流通总数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingQty

#### 6.4.119 名义本金总额

中文名称：名义本金总额

英文名称：Notional Principal Amount

标识符：0990

说明：在协议中所确定的债券或其他证券的发行规模，即要上市流通的资金数额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssueSize

#### 6.4.120 创设价格

中文名称：创设价格

英文名称：Creation Price

标识符：0991

说明：创设机构创设信用风险缓释凭证的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssuePx

#### 6.4.121 单位名义本金

中文名称：单位名义本金

英文名称：Unit Notional Principal

标识符：0992

说明：每一单位的名义本金额，创设价格对应的单位名义本金金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：FaceValue

#### 6.4.122 凭证注销机制

中文名称：凭证注销机制

英文名称：Certificate Revocation Mechanism

标识符：0993

说明：信用风险缓释凭证的注销机制。

数据类型：文本

取值：可注销、不可注销

IMIX 域名：WithdrawIndic

#### 6.4.123 创设日

中文名称：创设日

英文名称：Creation Date



标识符：0994

说明：信用风险缓释凭证创设日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：IssueDate

#### 6.4.124 流通日

中文名称：流通日

英文名称：Circulation Date

标识符：0995

说明：信用风险缓释凭证进行交易的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：ListDate

#### 6.4.125 登记确权日

中文名称：登记确权日

英文名称：Registration Confirmation Date

标识符：0996

说明：创设机构申请凭证初始登记，在托管机构登记确权的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：DatedDate

#### 6.4.126 收费方式

中文名称：收费方式

英文名称：Charging Method

标识符：0997

说明：依据不同的收费频率对收费方式进行的分类。

数据类型：文本

取值：前端一次性收费、按年付费、按季付费

IMIX 域名：FeeMethod

#### 6.4.127 首次付费日

中文名称：首次付费日

英文名称：First Payment Date

标识符：0998

说明：会员机构首次接入收费系统或其他计费平台的日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：CouponPaymentDate

#### 6.4.128 信用事件

中文名称：信用事件

英文名称：Credit Event

标识符：0999

说明：交易双方在相关交易有效约定中就一笔信用衍生品交易约定的触发结算赔付的事件。

数据类型：文本

取值：破产、支付违约、债务加速到期、债务违约、偿付变更、债务重组、其他

IMIX 域名：EventType

#### 6.4.129 违约结算方式

中文名称：违约结算方式

英文名称：Breach Settlement Method

标识符：1000

说明：违约情况下的实物结算、现金结算或其他方式。

数据类型：文本

取值：实物结算、现金结算、其他

IMIX 域名：无

#### 6.4.130 货币对类型

中文名称：货币对类型

英文名称：Currency Pair Type

标识符：1001

说明：货币对的分类。

数据类型：文本

取值：CNY CCY、G7 CCY、GOLD CCY

IMIX 域名：CNYTradedIndic

#### 6.4.131 货币名称

中文名称：货币名称

英文名称：Currency Name

标识符：1002

说明：按照GB/T 12406规定，货币名称有如下两种解释：

a) 货币在系统中的名称；

b) 一笔交易中涉及的币种，用以计算交易所占用的额度。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Currency

#### 6.4.132 货币类型名称

中文名称：货币类型名称

英文名称：Currency Type Name

标识符：1003

说明：货币分类的名称，如人民币、外币、贵金属。

数据类型：文本

取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.133 最小交易金额

中文名称：最小交易金额  
英文名称：Minimum Transaction Amount  
标识符：1004  
说明：交易员可输入的交易金额的最小允许值。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：MinQty

#### 6.4.134 最大交易金额

中文名称：最大交易金额  
英文名称：Maximum Transaction Amount  
标识符：1005  
说明：交易员可输入的交易金额的最大允许值。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：MaxQty

#### 6.4.135 价格波动区间

中文名称：价格波动区间  
英文名称：Price Range  
标识符：1006  
说明：交易价格相对于中间价的波动区间。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.136 每标位最低投标量

中文名称：每标位最低投标量  
英文名称：Lowest Bid Amount Per Standard Bit  
标识符：1007  
说明：同业存单招标发行时每标位所允许的最小投标数量。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.137 每标位最高投标量

中文名称：每标位最高投标量  
英文名称：Highest Bid Amount Per Standard Bit  
标识符：1008

说明：同业存单招标发行时每标位所允许的最大投标数量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.138 最低标位

中文名称：最低标位

英文名称：Lowest Standard Bit

标识符：1009

说明：同业存单招标发行时的最小标位。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.139 最高标位

中文名称：最高标位

英文名称：Highest Standard Bit

标识符：1010

说明：同业存单招标发行时的最大标位。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.140 最大投标标位数

中文名称：最大投标标位数

英文名称：Maximum Bid Marked

标识符：1011

说明：同业存单招标发行时所允许的最大标位的位数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.141 最大投标标位差

中文名称：最大投标标位差

英文名称：Maximum Bid Marked Difference

标识符：1012

说明：同业存单招标发行时所允许的最大的标位差，最大投标标位差的计算公式为：最大投标标位差=最高标位-最低标位。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.142 最高投标量

中文名称：最高投标量

英文名称：Highest Bid Amount

标识符：1013

说明：同业存单招标发行时系统所能允许会员机构进行的最大投标金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.143 连续投标限制

中文名称：连续投标限制

英文名称：Continuous Bid Limit

标识符：1014

说明：限制投标人根据步长，在连续的标位上进行投标。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.144 投标步长

中文名称：投标步长

英文名称：Tender Step

标识符：1015

说明：投标人更新投标额时投标额每次变动的固定值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.145 最低认购总量

中文名称：最低认购总量

英文名称：Minimum Subscription Amount

标识符：1016

说明：报价拍卖下投标人的最小认购金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.146 最高认购总量

中文名称：最高认购总量

英文名称：Maximum Subscription Amount

标识符：1017

说明：报价拍卖下投标人的最大认购金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.147 单笔最低认购量

中文名称：单笔最低认购量  
英文名称：Single Minimum Subscription Amount  
标识符：1018  
说明：报价拍卖下投标人单笔交易的最小认购金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.148 单笔最高认购量

中文名称：单笔最高认购量  
英文名称：Single Maximum Subscription Amount  
标识符：1019  
说明：报价拍卖下投标人单笔交易的最大认购金额。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.4.149 同业存单代码

中文名称：同业存单代码  
英文名称：Interbank Certificates of Deposit Code  
标识符：1020  
说明：同业存单发行时系统生成的唯一编码。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：SecurityID

#### 6.4.150 同业存单全称

中文名称：同业存单全称  
英文名称：Interbank Certificates of Deposit Full Name  
标识符：1021  
说明：同业存单在系统中的全称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：FullSymbol

#### 6.4.151 同业存单简称

中文名称：同业存单简称  
英文名称：Interbank Certificates of Deposit Short Name  
标识符：1022  
说明：同业存单在系统中的简称。  
数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Symbol

#### 6.4.152 注册书编号

中文名称：注册书编号

英文名称：Registration File Number

标识符：1023

说明：发行人机构的注册书编号，用于识别发行人身份。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.153 同业存单发行人

中文名称：同业存单发行人

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Issuer

标识符：1024

说明：发行同业存单的机构在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartyDetailAltSubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，同业存单发行人由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.4.154 主体评级机构

中文名称：主体评级机构

英文名称：Main Rating Agency

标识符：1025

说明：对同业存单发行人进行等级评定的组织或机构。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRatingAgency

#### 6.4.155 主体评级等级

中文名称：主体评级等级

英文名称：Main Rating Rank

标识符：1026

说明：针对同业存单、大额存单等交易标的发行人进行的具体信用等级评定。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：CreditRating

#### 6.4.156 同业存单发行方式

中文名称：同业存单发行方式

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Distribution Method

标识符: 1027

说明: 同业存单发行的方式。

数据类型: 文本

取值: 招标发行、报价发行

IMIX 域名: IssueMethod

#### 6.4.157 同业存单招标方式

中文名称: 同业存单招标方式

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Tender Method

标识符: 1028

说明: 同业存单招标发行时选择的招标方式。

数据类型: 文本

取值: 单一价格招标、数量招标

IMIX 域名: IssueMethod

#### 6.4.158 招标标的

中文名称: 招标标的

英文名称: Tender Underlying

标识符: 1029

说明: 进行单一价格招标时, 单一价格的对象。

数据类型: 文本

取值: 利差(BP)、价格(元)

IMIX 域名: 无

#### 6.4.159 同业存单计划发行量

中文名称: 同业存单计划发行量

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Planned Circulation

标识符: 1030

说明: 同业存单计划发行的总金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: IssueSizeForPlan

#### 6.4.160 最低发行量

中文名称: 最低发行量

英文名称: Minimum Circulation

标识符: 1031

说明: 政策法规或系统所能允许的最小发行金额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无



#### 6.4.161 同业存单息票类型

中文名称：同业存单息票类型

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Coupon Type

标识符：1032

说明：同业存单计算利息的类型。

数据类型：文本

取值：浮息、零息

IMIX 域名：CouponRateType

#### 6.4.162 同业存单期限

中文名称：同业存单期限

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Term

标识符：1033

说明：同业存单发行时所涵盖的期限。

数据类型：文本

取值：1M、3M、6M、9M、1Y、2Y、3Y

IMIX 域名：SecurityTerm

#### 6.4.163 同业存单面值

中文名称：同业存单面值

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Face Value

标识符：1034

说明：同业存单票面上标注的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：FaceValue

#### 6.4.164 同业存单发行价格

中文名称：同业存单发行价格

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Issue Price

标识符：1035

说明：同业存单发行的价格。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：IssuePx

#### 6.4.165 同业存单基准利率

中文名称：同业存单基准利率

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Benchmark Rate

标识符：1036

说明：同业存单计息时所针对的基准利率。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：BenchmarkPrice

#### 6.4.166 同业存单基准利率精度

中文名称：同业存单基准利率精度

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Benchmark Rate Precision

标识符：1037

说明：用于同业存单中利差的换算单位。如利差为30，当精度设置为2时表示小数点往前移动2位，此时换算后的利率为0.30。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：DecimalPlaces

#### 6.4.167 参考收益率

中文名称：参考收益率

英文名称：Reference Yield

标识符：1038

说明：据历史业绩得出的收益率的参考值，在一定程度上反映基金或债券等未来的成长方向，不能真正代表未来收益率。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.168 同业存单付息频率

中文名称：同业存单付息频率

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Coupon Frequency

标识符：1039

说明：同业存单支付利息的周期。

数据类型：文本

取值：月、季、半年、年、期满

IMIX 域名：CouponPaymentFrequency

#### 6.4.169 同业存单计息基准

中文名称：同业存单计息基准

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Interest Basis

标识符：1040

说明：同业存单计算利息时关于计息天数的处理规则。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：DayCount

#### 6.4.170 同业存单起息日

中文名称：同业存单起息日

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Value Date

标识符: 1041

说明: 同业存单开始计算利息的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: SettleDate

#### 6.4.171 同业存单首次付息日

中文名称: 同业存单首次付息日

英文名称: Interbank Certificates of Deposit First Coupon Payment Date

标识符: 1042

说明: 同业存单首次支付利息的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: CouponPaymentDate

#### 6.4.172 同业存单到期日

中文名称: 同业存单到期日

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Maturity Date

标识符: 1043

说明: 同业存单到期进行交割的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: MaturityDate

#### 6.4.173 兑付日

中文名称: 兑付日

英文名称: Payment Date

标识符: 1044

说明: 同业存单、大额存单等交易标的进行资金兑付的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: PaymentDate

#### 6.4.174 同业存单缴款日

中文名称: 同业存单缴款日

英文名称: Interbank Certificates of Deposit Payment Date

标识符: 1045

说明: 同业存单缴纳款项的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: EventDate (JR/T 0066一般以“EvtGrp”组件中的Type域和Date域组合表示同业存单缴款日)

#### 6.4.175 发行开始时间

中文名称：发行开始时间

英文名称：Issue Start Time

标识符：1046

说明：同业存单开始发行的时间。

数据类型：时间

取值：10:00、11:00、14:00、15:00、HH:MM

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和Date域组合表示发行开始时间）

#### 6.4.176 发行结束时间

中文名称：发行结束时间

英文名称：Issue End Time

标识符：1047

说明：同业存单发行结束的时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和Date域组合表示发行结束时间）

#### 6.4.177 同业存单状态

中文名称：同业存单状态

英文名称：Interbank Certificates of Deposit Status

标识符：1048

说明：同业存单在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：已撤销、待复核、发行设置待确认、待发行、发行中、发行成功、发行结果待确认、发行失败

IMIX 域名：无

#### 6.4.178 投标倍数

中文名称：投标倍数

英文名称：Tender Multiples

标识符：1049

说明：投标倍数的计算公式为：投标倍数=投标总量÷计划发行总量。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.179 债券状态

中文名称：债券状态

英文名称：Bond Status

标识符：1134

说明：用于描述债券基础信息在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、非活动、禁用、待处理、摘牌、待送审、待审核

IMIX 域名：无

#### 6.4.180 行权类型

中文名称：行权类型

英文名称：Exercise Type

标识符：1135

说明：债券中所包含的不同权利的分类。相对于含权类型，动态描述行权信息。

数据类型：文本

取值：发行人赎回权、投资人回售选择权、发行人上调票面利率选择权、发行人合并债券选择权、投资人调换债券选择权、发行人/投资人递延兑付选择权、投资人定向转让选择权、提前还本、其他选择权

IMIX 域名：EventType

#### 6.4.181 债券父类型

中文名称：债券父类型

英文名称：Bond Parent Type

标识符：1137

说明：债券类型的分类，包含利率债、信用债、同业存单，其中利率债又包含国债、地方政府债券、政策性金融债和央行票据等不同类型的债券。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.182 质押券代码

中文名称：质押券代码

英文名称：Pledged Bond Code

标识符：1144

说明：交易过程中质押的债券、资产支持证券等证券的代码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：UnderlyingSecurityID

#### 6.4.183 自律机制备案编码

中文名称：自律机制备案编码

英文名称：Self Regulatory Mechanism Code

标识符：1159

说明：大额存单信息复核完成后，系统自动生成的唯一编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名: SecurityID

#### 6.4.184 大额存单代码

中文名称: 大额存单代码

英文名称: CDs Code

标识符: 1160

说明: 发行机构发行大额存单时制定的代码。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: DepositID

#### 6.4.185 大额存单全称

中文名称: 大额存单全称

英文名称: CDs Full Name

标识符: 1161

说明: 发行机构发行大额存单时指定的大额存单全称描述。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: FullSymbol

#### 6.4.186 大额存单简称

中文名称: 大额存单简称

英文名称: CDs Short Name

标识符: 1162

说明: 发行机构发行大额存单时指定的大额存单简称描述。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: Symbol

#### 6.4.187 起存金额

中文名称: 起存金额

英文名称: Original Deposit

标识符: 1163

说明: 投资人认购大额存单的最低认购量。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: MinLotSize

#### 6.4.188 发行途径

中文名称: 发行途径

英文名称: Issue Approach

标识符: 1166

说明: 大额存单等交易标的的发行路径。

数据类型：文本

取值：中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心发行、本行自行发行

IMIX 域名：无

#### 6.4.189 大额存单发行方式

中文名称：大额存单发行方式

英文名称：CDs Issue Mode

标识符：1168

说明：发行机构发行大额存单的具体方法。

数据类型：文本

取值：报价发行

IMIX 域名：IssueMethod

#### 6.4.190 实际认购量

中文名称：实际认购量

英文名称：Actual Subscription Amount

标识符：1169

说明：发行机构发行的大额存单等交易标的被实际购买的金额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.191 计息类型

中文名称：计息类型

英文名称：Interest Type

标识符：1170

说明：利息计算时使用的不同利息分类。

数据类型：文本

取值：浮息、固息

IMIX 域名：CouponRateType

#### 6.4.192 大额存单期限

中文名称：大额存单期限

英文名称：CDs Period

标识符：1171

说明：大额存单的发行期限，超过此期限，大额存单即到期。

数据类型：文本

取值：1M、3M、6M、9M、1Y、18M、2Y、3Y、5Y

IMIX 域名：SecurityTerm

#### 6.4.193 大额存单利率上限

中文名称：大额存单利率上限

英文名称：CDs Cap Rate

标识符：1172

说明：大额存单发行人支付的上限利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.194 大额存单利率下限

中文名称：大额存单利率下限

英文名称：CDs Floor Rate

标识符：1173

说明：大额存单发行人支付的下限利率。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.195 大额存单基准利率精度

中文名称：大额存单基准利率精度

英文名称：CDs Benchmark Rate Precision

标识符：1174

说明：用于大额存单中利差的换算单位。如利差为30，当精度设置为2时表示小数点往前移动2位，此时换算后的利率为0.30。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：DecimalPlaces

#### 6.4.196 大额存单付息频率

中文名称：大额存单付息频率

英文名称：CDs Coupon Frequency

标识符：1175

说明：用于描述大额存单进行利息支付的周期。

数据类型：文本

取值：月、季、半年、年、期满

IMIX 域名：CouponPaymentFrequency

#### 6.4.197 大额存单发行开始时间

中文名称：大额存单发行开始时间

英文名称：CDs Issue Start Time

标识符：1176

说明：发行机构发行大额存单的具体开始时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和Date域组合表示大额存单发行开始时间）



**6.4.198 大额存单发行结束时间**

中文名称：大额存单发行结束时间

英文名称：CDs Issue End Time

标识符：1177

说明：发行机构发行大额存单的具体结束时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvtGrp”组件中的Type域和Date域组合表示大额存单发行结束时间）

**6.4.199 最小变动单位**

中文名称：最小变动单位

英文名称：Minimum Changeable Unit

标识符：0085

说明：大额存单等交易标的进行报价等活动时最小的变动步长。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：MinTickSize

**6.4.200 是否对外披露**

中文名称：是否对外披露

英文名称：Disclosure Indicator

标识符：1178

说明：用于描述发行机构的大额存单等交易标的的发行要素等信息是否对外公开。

数据类型：文本

取值：是、否

IMIX 域名：无

**6.4.201 提前赎回条件**

中文名称：提前赎回条件

英文名称：Early Redemption Conditions

标识符：1179

说明：用于描述大额存单等交易标的进行提前赎回时的条件。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

**6.4.202 提前支取条件**

中文名称：提前支取条件

英文名称：Early Withdraw Conditions

标识符：1180

说明：用于描述大额存单等交易标的进行提前支取时的条件。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.203 大额存单发行状态

中文名称：大额存单发行状态

英文名称：CDs Issue Status

标识符：1181

说明：用于描述大额存单发行成功前在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：待复核、已撤销、发行信息待确认、待发行、发行中、发行结果待录入、发行结果待复核、发行成功、发行失败

IMIX 域名：无

#### 6.4.204 提交用户 ID

中文名称：提交用户ID

英文名称：Submit User ID

标识符：1182

说明：大额存单发行要素录入的机构用户登录名。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.205 复核用户 ID

中文名称：复核用户ID

英文名称：Review User ID

标识符：1183

说明：大额存单发行要素复核的机构用户登录名。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.206 场务确认用户 ID

中文名称：场务确认用户ID

英文名称：MSC Confirm User ID

标识符：1184

说明：场务对存单信息进行确认的用户登录名。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.4.207 发行结果录入用户 ID

中文名称：发行结果录入用户ID

英文名称: Issue Results Entry User ID  
 标识符: 1185  
 说明: 大额存单发行结果录入的机构用户登录名。  
 数据类型: 文本  
 取值: 无  
 IMIX 域名: 无

#### 6.4.208 发行结果复核用户 ID

中文名称: 发行结果复核用户 ID  
 英文名称: Issue Results Review User ID  
 标识符: 1186  
 说明: 大额存单发行结果录入信息复核的机构用户登录名。  
 数据类型: 文本  
 取值: 无  
 IMIX 域名: 无

#### 6.4.209 大额存单状态

中文名称: 大额存单状态  
 英文名称: CDs Status  
 标识符: 1187  
 说明: 用于描述发行成功的大额存单在系统中所处的状态。  
 数据类型: 文本  
 取值: 活动、禁用  
 IMIX 域名: 无

#### 6.4.210 流通范围

中文名称: 流通范围  
 英文名称: Circulation Scope  
 标识符: 1205  
 说明: 用于描述存单交易流通的范围, 包含公开发行、定向发行。具体内容如下:  
 a) 公开发行的同业存单可进行交易流通, 并可作为回购交易的标的物;  
 b) 定向发行的同业存单只能在该只同业存单初始投资人范围内流通转让。  
 数据类型: 文本  
 取值: 公开、定向  
 IMIX 域名: TradePublishIndicator

#### 6.4.211 期限标识

中文名称: 期限标识  
 英文名称: Period Indicator  
 标识符: 1206  
 说明: 用于描述存单发行时所指的期限。  
 数据类型: 文本  
 取值: 1M、3M、6M、9M、1Y、2Y、3Y、其他

IMIX 域名: SecurityTerm

#### 6.4.212 定向期限代码

中文名称: 定向期限代码

英文名称: Directional Period Code

标识符: 1207

说明: 用于描述定向发行的存单期限的唯一标识。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.4.213 定向期限值

中文名称: 定向期限值

英文名称: Directional Period Value

标识符: 1208

说明: 用于记录定向发行的存单的具体期限值, 依据存单的到期日进行推算得出。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

### 6.5 条件

#### 6.5.1 交易日

中文名称: 交易日

英文名称: Trading Date

标识符: 0462

说明: 根据不同应用场景, 具体有以下两种业务解释:

- a) 交易双方达成一笔交易的日期, 此时同“成交日期”;
- b) 各交易品种可在银行间外汇市场进行交易的日期。

数据类型: 日期

取值: 无

IMIX 域名: TradeDate

#### 6.5.2 假日类型

中文名称: 假日类型

英文名称: Holiday Type

标识符: 0856

说明: 依据可执行业务的不同对假日进行的区分。

数据类型: 文本

取值: 交易假日、清算假日

IMIX 域名: 无

#### 6.5.3 假日日期

中文名称：假日日期  
英文名称：Holiday Date  
标识符：0857  
说明：具体的节假日日期。  
数据类型：日期  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.4 年度

中文名称：年度  
英文名称：Year  
标识符：0858  
说明：日期所属的年份。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.5 假日事件描述

中文名称：假日事件描述  
英文名称：Holiday Description  
标识符：0859  
说明：对于假日事件的简单描述。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.6 假日表名称

中文名称：假日表名称  
英文名称：Calendar Table Name  
标识符：0860  
说明：交易假日表、清算假日表的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.7 交易时段类型

中文名称：交易时段类型  
英文名称：Trading Session Type  
标识符：0861  
说明：对交易时段的分类。  
数据类型：文本  
取值：开市、开盘、停盘、复盘、收盘、闭市  
IMIX 域名：TradSesStatus

#### 6.5.8 市场可操作类型

中文名称：市场可操作类型

英文名称：Market Available Operation Type

标识符：0862

说明：用于描述市场在不同的交易时段内能进行的操作类型。

数据类型：文本

取值：报价、交易

IMIX 域名：无

#### 6.5.9 交易时段状态

中文名称：交易时段状态

英文名称：Trading Hour Status

标识符：0863

说明：交易时段在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：待处理、进行中、关闭

IMIX 域名：无

#### 6.5.10 默认开始时间

中文名称：默认开始时间

英文名称：Default Start Time

标识符：0864

说明：交易时段类型的默认开始时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TradSesStartTime或者TradSesOpenTime

#### 6.5.11 默认结束时间

中文名称：默认结束时间

英文名称：Default End Time

标识符：0865

说明：交易时段类型的默认结束时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：TradSesPreCloseTime或者TradSesCloseTime或者TradSesEndTime

#### 6.5.12 交易时段类型权限配置名称

中文名称：交易时段类型权限配置名称

英文名称：Permission Configuration Name of Trading Session Type

标识符：0866

说明：用于描述市场中各交易时段类型对应的权限。

数据类型：文本

取值：开市权限、开盘权限、停盘权限、复盘权限、收盘权限、闭市权限  
IMIX 域名：无

#### 6.5.13 计费办法名称

中文名称：计费办法名称  
英文名称：Fee Method Name  
标识符：0867  
说明：计费办法的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.14 交易费率名称

中文名称：交易费率名称  
英文名称：Trading Fee Rate Name  
标识符：0868  
说明：交易费率的名称。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.15 交易发起方标识

中文名称：交易发起方标识  
英文名称：Taker Indicator  
标识符：0869  
说明：用来区分一笔交易中的发起方和接收方。  
数据类型：文本  
取值：无  
IMIX 域名：PartyRole

#### 6.5.16 交易费率值

中文名称：交易费率值  
英文名称：Trading Fee Rate Value  
标识符：0870  
说明：交易费用计算的参数值。  
数据类型：数值  
取值：无  
IMIX 域名：无

#### 6.5.17 交易费率值描述

中文名称：交易费率值描述  
英文名称：Trading Fee Rate Value Description  
标识符：0871

说明：针对交易费率值的说明。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.18 临界方式类型

中文名称：临界方式类型

英文名称：Critical Bound Mode Type

标识符：0872

说明：当交易费用达到优惠区间的边界时确定计费费率的方式。

数据类型：文本

取值：左开右闭、左闭右开

IMIX 域名：无

#### 6.5.19 优惠值

中文名称：优惠值

英文名称：Discount Value

标识符：0873

说明：特殊优惠的触发值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.20 左端值

中文名称：左端值

英文名称：Left End Value

标识符：0874

说明：优惠区间的起始值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.21 右端值

中文名称：右端值

英文名称：Right End Value

标识符：0875

说明：优惠区间的结束值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.22 特殊费率名称

中文名称：特殊费率名称



英文名称: Name Of Special Fee Rate

标识符: 0876

说明: 特殊费率在系统中的名称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.5.23 特殊费率值

中文名称: 特殊费率值

英文名称: Special Fee Rate Value

标识符: 0877

说明: 计算特殊费率的参数值。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.5.24 特殊费率值描述

中文名称: 特殊费率值描述

英文名称: Description of Special Fee Rate Value

标识符: 0878

说明: 针对特殊费率值的说明。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.5.25 终端类型

中文名称: 终端类型

英文名称: Terminal Type

标识符: 0879

说明: 依据会员机构的不同身份划分的终端计费类型。

数据类型: 文本

取值: 会员终端、全做市商、外币对做市商、人民币外汇做市商

IMIX 域名: 无

#### 6.5.26 终端费率名称

中文名称: 终端费率名称

英文名称: Name of Terminal Fee Rate

标识符: 0880

说明: 终端费率在系统中的名称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.5.27 终端费单价

中文名称：终端费单价

英文名称：Terminal Charge Unit Price

标识符：0881

说明：用于记录不同终端的单价，以及相同终端不同数量区间的单价（相同终端在不同数量区间的单价不相同）。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.28 信息服务费率名称

中文名称：信息服务费率名称

英文名称：Name of Information Service Fee Rate

标识符：0882

说明：信息服务费率在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.29 数据传输类型

中文名称：数据传输类型

英文名称：Data Transfer Type

标识符：0883

说明：信息服务数据的传输方式。

数据类型：文本

取值：实时传输、定时传输、标准数据传输

IMIX 域名：无

#### 6.5.30 下载方式

中文名称：下载方式

英文名称：Download Method

标识符：0884

说明：会员机构下载信息服务数据的方式。

数据类型：文本

取值：定时传输、实时传输、报表、标准数据接口

IMIX 域名：无

#### 6.5.31 信息服务费率值

中文名称：信息服务费率值

英文名称：Value of Information Service Fee Rate

标识符：0885

说明：针对各信息产品在不同数据传输类型或下载方式中设定的服务费计算参数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.32 费用类型名称

中文名称：费用类型名称

英文名称：Fee Type Name

标识符：0886

说明：费用的具体分类对应的名称。

数据类型：文本

取值：交易手续费、佣金、交易终端费、做市商终端费、CSTP增值服务费、场务人工信息服务费、信息服务费（对应本币的数据接口费）

IMIX 域名：无

#### 6.5.33 开始日期

中文名称：开始日期

英文名称：Starting Date

标识符：1227

说明：初始可操作日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：StartDate

#### 6.5.34 开始时间

中文名称：开始时间

英文名称：Starting Time

标识符：1228

说明：初始可操作时间。

数据类型：时间

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.5.35 截止日期

中文名称：截止日期

英文名称：Closing Date

标识符：0887

说明：最后可操作日期。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EndDate

#### 6.5.36 截止时间

中文名称：截止时间

英文名称: Ending Time

标识符: 0888

说明: 最后可操作时间。

数据类型: 时间

取值: 无

IMIX 域名: 无

## 6.6 风险控制

### 6.6.1 检查类型

中文名称: 检查类型

英文名称: Check Type

标识符: 1051

说明: 系统进行授信关系检查的方式。

数据类型: 文本

取值: 单向检查、双向检查

IMIX 域名: 无

### 6.6.2 授信关系检查结果

中文名称: 授信关系检查结果

英文名称: Result of Credit Relationship Check

标识符: 1052

说明: 用于表示授信关系检查是否通过。

数据类型: 文本

取值: 通过、不通过

IMIX 域名: 无

### 6.6.3 授信方式名称

中文名称: 授信方式名称

英文名称: Credit Mode Name

标识符: 1053

说明: 授信方式的名称。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: RiskLimitUpdateMethod

### 6.6.4 单笔最大限额

中文名称: 单笔最大限额

英文名称: Single Max Limit

标识符: 1054

说明: 交易员所能达成的单笔最大成交量。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名：无

#### 6.6.5 分行机构名称

中文名称：分行机构名称

英文名称：Branch Name

标识符：1055

说明：具有总分行关系的机构中分行机构在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.6 总行机构名称

中文名称：总行机构名称

英文名称：Headquarter Name

标识符：1056

说明：具有总分行关系的机构中总行机构在系统中的名称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.7 买入限额

中文名称：买入限额

英文名称：Buy Limit

标识符：0258

说明：分行机构在买入/拆入/支付/正回购/融入方向上所允许交易的额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.8 卖出限额

中文名称：卖出限额

英文名称：Sell Limit

标识符：0237

说明：分行机构在卖出/拆出/收取/逆回购/融出方向上所允许交易的额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.9 分行最小净限额

中文名称：分行最小净限额

英文名称：Branch Minimum Net Limit

标识符：1057

说明：总行针对其分行机构设置的可成交的最小净限额，净限额的计算公式为：净限额=买入方向限额-卖出方向限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.10 分行最大净限额

中文名称：分行最大净限额

英文名称：Branch Maximum Net Limit

标识符：1058

说明：总行针对其分行机构设置的可成交的最大净限额，净限额的计算公式为：净限额=买入方向限额-卖出方向限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.11 买入限额预警值

中文名称：买入限额预警值

英文名称：Buy Limit Prewarning Value

标识符：1059

说明：总行机构为其分行机构在买入方向上设置的超过一定界限值进行提示或限制的预警值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.12 卖出限额预警值

中文名称：卖出限额预警值

英文名称：Sell Limit Prewarning Value

标识符：1060

说明：总行机构为其分行机构在卖出方向上设置的超过一定界限值进行提示或限制的预警值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.13 最小净限额预警值

中文名称：最小净限额预警值

英文名称：Minimum Net Limit Prewarning Value

标识符：1061

说明：总行机构为其分行机构在最小净限额上设置的超过一定界限值进行提示或限制的预警值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.14 最大净限额预警值

中文名称：最大净限额预警值

英文名称：Maximum Net Limit Prewarning Value

标识符：1062

说明：总行机构为其分行机构在最大净限额上设置的超过一定界限值进行提示或限制的预警值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.15 做市券种代码

中文名称：做市券种代码

英文名称：Market Bonds Code

标识符：1063

说明：做市券种在系统中的唯一编码。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：SecurityID

#### 6.6.16 做市机构名称

中文名称：做市机构名称

英文名称：Market Institution Name

标识符：1064

说明：做市机构在系统中的中文简称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartySubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，做市机构名称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.6.17 做市券种最小净限额

中文名称：做市券种最小净限额

英文名称：Market Bonds Minimum Net Limit

标识符：1065

说明：针对做市券种设置的净限额最小值，做市券种净限额的计算公式为：做市券种净限额=做市券种买入总额-做市券种卖出总额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.18 做市券种最大净限额

中文名称：做市券种最大净限额

英文名称：Market Bonds Maximum Net Limit

标识符：1066

说明：针对做市券种设置的净限额最大值，做市券种净限额的计算公式为：做市券种净限额=做市券种买入总额-做市券种卖出总额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.19 做市券种当日已用净限额

中文名称：做市券种当日已用净限额

英文名称：Market Bonds Used Net Limit

标识符：1067

说明：做市券种在市场中当日被使用的净限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.20 做市券种当日剩余净限额

中文名称：做市券种当日剩余净限额

英文名称：Market Bonds Available Net Limit

标识符：1068

说明：做市券种的当日剩余可使用的净限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.21 限额类型

中文名称：限额类型

英文名称：Limit Type

标识符：0106

说明：不同种类限额的分类。

数据类型：文本

取值：政策性限额、交易员单笔交易限额、分行限额、中央对手方限额、双边撮合授信限额、做市券种每日限额

IMIX 域名：无

#### 6.6.22 限额值类型

中文名称：限额值类型

英文名称：Limit Value Type

标识符：1069

说明：限额取值的类型。

数据类型：文本

取值：量、期限、比例

IMIX 域名：无



### 6.6.23 政策性限额类型

中文名称：政策性限额类型

英文名称：Policy Limit Type

标识符：1070

说明：政策性限额按照量、期限、比例进行的分类，同一产品可对应多个政策性限额类型。

数据类型：文本

取值：人民币拆借拆入拆出限额、人民币拆借拆入拆出最大期限、证券公司回购未到期金额与其实收资本比例、基金公司回购未到期金额与基金资产净值比例、机构待返售债券余额与该只债券流通量比例、待返售债券总余额与其自营债券总量比例、机构债券卖出总余额与该只债券流通量比例、机构债券买入总余额与该只债券流通量比例、外资机构净买入金额与其人民币营运资金比例、基金公司净买入金额与基金资产净值比例、机构净买入金额与其资本比例、卖出总余额与其可用自由债券总量比例

IMIX 域名：无

### 6.6.24 政策性限额映射关系状态

中文名称：政策性限额映射关系状态

英文名称：Policy Limit Mapping Status

标识符：1071

说明：政策性限额映射关系在系统中所处的状态。

数据类型：文本

取值：活动、禁用

IMIX 域名：无

### 6.6.25 最大买入限额值

中文名称：最大买入限额值

英文名称：Maximum Buy Limit

标识符：1072

说明：机构在买入方向上的最大政策性限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.6.26 最大卖出限额值

中文名称：最大卖出限额值

英文名称：Maximum Sell Limit

标识符：1073

说明：机构在卖出方向上的最大政策性限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

### 6.6.27 临时最大买入限额值

中文名称：临时最大买入限额值

英文名称: Temporary Maximum Buy Limit  
标识符: 1074  
说明: 机构在买入方向上的临时的最大政策性限额。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.6.28 临时最大卖出限额值

中文名称: 临时最大卖出限额值  
英文名称: Temporary Maximum Sell Limit  
标识符: 1075  
说明: 机构在卖出方向上的临时的最大政策性限额。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.6.29 临时限额生效时间

中文名称: 临时限额生效时间  
英文名称: Temporary Limit Effective Time  
标识符: 1076  
说明: 临时政策性限额在系统中生效的时间。  
数据类型: 时间  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.6.30 临时限额失效时间

中文名称: 临时限额失效时间  
英文名称: Temporary Limit Invalid Time  
标识符: 1077  
说明: 临时政策性限额在系统中失效的时间。  
数据类型: 时间  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.6.31 最大买入期限值

中文名称: 最大买入期限值  
英文名称: Maximum Buy Term  
标识符: 1078  
说明: 会员机构在不同产品买入方向上的最大可交易期限。  
数据类型: 数值  
取值: 无  
IMIX 域名: 无

#### 6.6.32 最大卖出期限值

中文名称：最大卖出期限值

英文名称：Maximum Sell Term

标识符：1079

说明：会员机构在不同产品卖出方向上的最大可交易期限。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.33 限额比例

中文名称：限额比例

英文名称：Limit Proportion

标识符：1080

说明：会员设置的政策性限额比例。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.34 额度状态

中文名称：额度状态

英文名称：Limit Status

标识符：1081

说明：拍卖交易模式下设置的发行额度在系统中的状态。

数据类型：文本

取值：启用、禁用

IMIX 域名：无

#### 6.6.35 已占用限额比例

中文名称：已占用限额比例

英文名称：Occupied Limit Proportion

标识符：1082

说明：已占用限额占总限额的比例值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.36 限额预警比例

中文名称：限额预警比例

英文名称：Limit Alert Proportion

标识符：1083

说明：会员机构预警值占总限额的比例，一旦超过该预警值，系统予以预警或限额操作。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.37 已用买入限额

中文名称：已用买入限额

英文名称：Used Buy Limit

标识符：1084

说明：会员已经占用的买入限额额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.38 可用买入限额

中文名称：可用买入限额

英文名称：Available Buy Limit

标识符：1085

说明：会员剩余可用的买入限额额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.39 已用卖出限额

中文名称：已用卖出限额

英文名称：Used Sell Limit

标识符：1086

说明：会员已经占用的卖出限额额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.40 可用卖出限额

中文名称：可用卖出限额

英文名称：Available Sell Limit

标识符：1087

说明：会员剩余可用的卖出限额额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.41 限额预警值

中文名称：限额预警值

英文名称：Limit Alert Value

标识符：1088

说明：机构的政策性限额监测预警值，一旦机构交易额度超过此预警值，系统进行预警或限额操作。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.42 授信机构名称

中文名称：授信机构名称

英文名称：Credit Institution Name

标识符：1089

说明：与本方机构有授信关系的对手方机构中文简称。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：PartyDetailSubID（JR/T 0066一般以“Party”组件描述机构实体，以“Party”下的子组件“SubGrp”描述机构实体详细信息，授信机构名称由“SubGrp”组件中的Type域和ID域组合表示）

#### 6.6.43 初始授信额度

中文名称：初始授信额度

英文名称：Original Credit Limit

标识符：1090

说明：会员机构对其对手方自行设置的最大可成交额，超过此额度，机构之间的交易无法达成。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskLimitAmount

#### 6.6.44 已用授信额度

中文名称：已用授信额度

英文名称：Used Credit Limit

标识符：1091

说明：已清算的交易所占用的额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.45 可用授信额度

中文名称：可用授信额度

英文名称：Available Credit Limit

标识符：1092

说明：会员机构之间剩余可使用的交易额度，可用授信额度的计算公式为：可用授信额度=初始授信额度-已用授信额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskLimitRemainingtAmt

#### 6.6.46 最长期限

中文名称：最长期限

英文名称：Maximum Term

标识符：1093

说明：不同合约品种的最长期限值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskTerm

#### 6.6.47 预警比例

中文名称：预警比例

英文名称：Alert Proportion

标识符：1094

说明：系统对机构已用授信额度/初始授信额度，达到或超过设定的比例进行预警，从而控制风险。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.48 实际占用额度比例

中文名称：实际占用额度比例

英文名称：Actual Used Proportion

标识符：1095

说明：当前机构已用授信额度占初始授信额度的比例。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.49 额度更新方式

中文名称：额度更新方式

英文名称：Limit Update Method

标识符：1096

说明：在指令驱动交易模式下，会员双边授信额度的更新方式。

数据类型：文本

取值：还原最新设置初始值、使用前一交易日剩余授信额度

IMIX 域名：无

#### 6.6.50 额度返还方式

中文名称：额度返还方式

英文名称：Limit Return Method

标识符：1097

说明：交易到期时，向机构或交易员返还额度的方式。

数据类型：文本

取值：到期自动返还、不返还

IMIX 域名：无

#### 6.6.51 合约品种

中文名称：合约品种

英文名称：Contract Type

标识符：1098

说明：互换市场中会员机构进行报价、交易的标的。

数据类型：文本

取值：FR007\_3M、FR007\_6M、FR007\_1Y、FR007\_2Y、FR007\_3Y、FR007\_4Y、FR007\_5Y、FR007\_1Y\*2Y、FR007\_2Y\*5Y、Shibor3M\_6M、Shibor3M\_1Y、Shibor3M\_2Y、Shibor3M\_3Y、Shibor3M\_4Y、Shibor3M\_5Y、Shibor3M\_1Y\*2Y、Shibor3M\_2Y\*5Y

IMIX 域名：SecurityID

#### 6.6.52 风险系数

中文名称：风险系数

英文名称：Risk Coefficient

标识符：1099

说明：针对不同合约品种设置的风险系数。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskInstrumentMultiplier

#### 6.6.53 初始额度

中文名称：初始额度

英文名称：Original Limit

标识符：1100

说明：根据统一的授信制度，对每个会员分别授予的交易总额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskLimitAmount

#### 6.6.54 剩余可用额度

中文名称：剩余可用额度

英文名称：Remain Available Limit

标识符：1102

说明：初始额度扣除暂扣额度和已用额度后的额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：RiskLimitRemainingtAmt

#### 6.6.55 已用净限额

中文名称：已用净限额

英文名称: Used Net Limit

标识符: 1103

说明: 会员机构已经使用的净限额, 已用净限额的计算公式为: 已用净限额=已用买入限额-已用卖出限额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.6.56 可用净限额

中文名称: 可用净限额

英文名称: Available Net Limit

标识符: 1104

说明: 会员机构剩余可使用的净限额, 可用净限额的计算公式为: 可用净限额=净限额-已用净限额。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.6.57 已用比例

中文名称: 已用比例

英文名称: Used Proportion

标识符: 1105

说明: 会员机构已经使用的额度所占的比例。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.6.58 限额检查结果

中文名称: 限额检查结果

英文名称: Limit Check Result

标识符: 1106

说明: 会员机构报价、交易前系统对其各类型限额进行检查的结果。

数据类型: 文本

取值: 通过、不通过

IMIX 域名: 无

#### 6.6.59 暂扣额度

中文名称: 暂扣额度

英文名称: Hold Limit

标识符: 1107

说明: 对已经发起但未成交的交易暂扣的额度, 根据会员每笔报价的卖出币种金额、内部折算率计算。

数据类型: 数值

取值: 无



IMIX 域名: RiskLimitHoldAmount

#### 6.6.60 净暂扣额度

中文名称: 净暂扣额度

英文名称: Net Hold Limit

标识符: 1108

说明: 会员机构在买入方向上暂扣额度与卖出方向上暂扣额度的差值。

数据类型: 数值

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.6.61 业务资格类型

中文名称: 业务资格类型

英文名称: Business Qualifications Type

标识符: 1109

说明: 会员机构所能拥有的业务资格在系统中的分类。

数据类型: 文本

取值: 主协议签署机构、确认签署机构

IMIX 域名: 无

#### 6.6.62 业务资格标识

中文名称: 业务资格标识

英文名称: Business Qualifications Identify

标识符: 1110

说明: 用于标识会员机构是否具有业务资格。

数据类型: 文本

取值: 无

IMIX 域名: 无

#### 6.6.63 授信类型

中文名称: 授信类型

英文名称: Credit Type

标识符: 0065

说明: 针对授信作用的不同对象而对授信进行的分类。

数据类型: 文本

取值: 成员间授信、总分行授信、交易员授信

IMIX 域名: 无

#### 6.6.64 授信子类型

中文名称: 授信子类型

英文名称: Credit Sub Type

标识符: 0064

说明: 因作用的限额不同, 对授信类型的进一步分类。

数据类型：文本

取值：单笔交易限额、交易限额、交易员单笔限额、政策性限额、会员双边撮合限额、中央对手方限额、分行限额、做市券种每日限额、结算限额

IMIX 域名：无

#### 6.6.65 限额值

中文名称：限额值

英文名称：Limit Value

标识符：1122

说明：针对各限额设置的具体限额值。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.66 做市券种名称

中文名称：做市券种名称

英文名称：Market Bonds Name

标识符：1123

说明：做市券种在系统中的名称，如债券名称、资产支持证券名称等。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：Symbol

#### 6.6.67 最小净限额

中文名称：最小净限额

英文名称：Minimum Net Limit

标识符：0088

说明：系统设置的净限额所能允许的最小值，净限额的计算公式为：净限额=买入方向限额-卖出方向限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.68 最大净限额

中文名称：最大净限额

英文名称：Maximum Net Limit

标识符：0084

说明：系统设置的净限额所能允许的最大值，净限额的计算公式为：净限额=买入方向限额-卖出方向限额。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.69 发行备案起始日

中文名称：发行备案起始日

英文名称：Issue Record Start Date

标识符：1188

说明：发行机构在某时间段内设置的发行限额的起始日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和 Date域组合表示发行备案起始日）

#### 6.6.70 发行备案终止日

中文名称：发行备案终止日

英文名称：Issue Record End Date

标识符：1189

说明：发行机构在某时间段内设置的发行限额的终止日。

数据类型：日期

取值：无

IMIX 域名：EventDate（JR/T 0066一般以“EvntGrp”组件中的Type域和 Date域组合表示发行备案终止日）

#### 6.6.71 可用限额

中文名称：可用限额

英文名称：Available Limit

标识符：1190

说明：发行机构在大额存单上可用的发行额度。

数据类型：数值

取值：无

IMIX 域名：无

#### 6.6.72 大额存单发行限额状态

中文名称：大额存单发行限额状态

英文名称：CDs Issue Limit Status

标识符：1191

说明：发行机构设置的发行备案额度在系统中所处的状态，包含启用等。

数据类型：文本

取值：无

IMIX 域名：无

### 参 考 文 献

- [1] GB/T 1988—1998 信息技术 信息交换用七位编码字符集
  - [2] GB/T 2260—2007 中华人民共和国行政区划代码
  - [3] GB/T 2261.1—2003 个人基本信息分类与代码 第1部分：人的性别代码
  - [4] GB/T 2261.2—2003 个人基本信息分类与代码 第2部分：婚姻状况代码
  - [5] GB/T 2312—1980 信息交换用汉字编码字符集 基本集
  - [6] GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码
  - [7] GB/T 4658—2006 学历代码
  - [8] GB/T 4754—2017 国民经济行业分类
  - [9] GB/T 6565—2015 职业分类与代码
  - [10] GB/T 6864—2003 中华人民共和国学位代码
  - [11] GB/T 10113—2003 分类与编码通用术语
  - [12] GB 11643—1999 公民身份号码
  - [13] GB 11714—1997 全国组织机构代码编制规则
  - [14] GB/T 12402—2000 经济类型分类与代码
  - [15] GB/T 18391.1—2009 信息技术 元数据注册系统（MDR） 第1部分：框架
  - [16] ISO 10962:2015 Securities and related financial instruments - Classification of financial instruments (CFI code)
-