



中国证券监督管理委员会
CHINA SECURITIES REGULATORY COMMISSION

证券期货监督管理信息公开目录

索引号:40000895X/
发布机构:证监会
名称:【第15号公告】
文号:证监会公告[2020]15号

分类:其他;证监会公告
发文日期:2020年02月26日
主题词:

【第15号公告】

中国证券监督管理委员会公告

〔2020〕15号

现公布金融行业推荐性标准《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分:证券》(JR/T 0177.1-2020)、《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第2部分:期货》(JR/T 0177.2-2020)、《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分:基金》(JR/T 0177.3-2020)、《期货合约要素》(JR/T 0181-2020)、《轻量级实时STEP消息传输协议》(JR/T 0182-2020)、《证券期货业投资者识别码》(JR/T 0183-2020),自公布之日起施行。

中

国证监会

2020年2月26日

[证监会发布《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式》等六项金融行业标准](#)

[附件1:《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分:证券》.pdf](#)

[附件2:《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第2部分:期货》.pdf](#)

[附件3:《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分:基金》.pdf](#)

[附件4:《期货合约要素》.pdf](#)

[附件5:《轻量级实时STEP消息传输协议》.pdf](#)

[附件6:《证券期货业投资者识别码》.pdf](#)



中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0177.1—2020

证券期货业投资者权益相关数据的内容和 格式 第1部分：证券

Contents and formats of data on investors' rights and interests in the securities and
futures industry—Part 1: Securities

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言..... II

1 范围..... 1

2 规范性引用文件..... 1

3 术语和定义..... 1

4 数据类别及类型..... 1

 4.1 数据类别..... 2

 4.2 数据类型..... 2

5 数据内容及格式..... 2

 5.1 投资者账户数据..... 2

 5.1.1 投资者信息数据..... 2

 5.1.2 投资者资金账号数据..... 4

 5.1.3 投资者证券账号数据..... 4

 5.1.4 投资者存管账号数据..... 5

 5.2 经纪业务数据..... 6

 5.2.1 投资者资金余额数据..... 6

 5.2.2 投资者证券余额数据..... 6

 5.2.3 投资者限售股余额数据..... 7

 5.3 信用业务数据..... 8

 5.3.1 投资者股票质押合同数据..... 8

 5.3.2 投资者约定购回合同数据..... 9

 5.3.3 投资者债券质押式回购数据..... 11

 5.3.4 投资者两融合同数据..... 12

 5.3.5 投资者两融资金余额数据..... 13

 5.3.6 投资者两融证券余额数据..... 14

 5.3.7 投资者两融合约负债数据..... 15

 5.3.8 投资者两融资产负债数据..... 17

 5.3.9 投资者融券权益补偿数据..... 17

 5.4 衍生品业务数据..... 18

 5.4.1 投资者期权资金余额数据..... 18

 5.4.2 投资者期权持仓数据..... 19

附录 A （规范性附录） 数据字典..... 21

附录 B （规范性附录） 代码取值及描述..... 26

参考文献..... 35

前 言

JR/T 0177—2020《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式》分为3部分内容：

——第1部分：证券；

——第2部分：期货；

——第3部分：基金。

本部分为JR/T 0177—2020的第1部分。

本部分依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本部分由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本部分起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、中证信息技术服务有限责任公司、恒生电子股份有限公司。

本部分主要起草人：姚前、刘铁斌、罗凯、王东明、周云晖、路一、周桢、罗璇、贾石、韩晓红、朱仲春、苏杭、杨振江。

证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第1部分：证券

1 范围

本部分规定了证券业投资者权益数据的数据类别及类型、数据内容及格式等内容，数据内容及格式包括投资者账户数据、经纪业务数据、信用业务数据及衍生品业务数据等。

本部分适用于行业机构开展证券业投资者权益数据治理相关工作。

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，仅所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/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 4658—2006 学历代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

JR/T 0046—2009 证券期货业与银行间业务数据交换消息体结构和设计规则

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

证券投资者 securities investor

参与股票市场等场内证券市场的投资者。

注：主要有机构投资者和个人投资者。

3.2

投资者权益 investors' rights and interests

投资者因投资证券所产生的权利和行使权利所带来的利益。

注：投资者资产扣除负债后，由投资者享有的剩余权益。

3.3

资金账户 fund account

投资者用于证券交易资金清算的专用账户。

注：根据用途不同资金账户可分为普通资金账户、信用资金账户、衍生品资金账户等。

3.4

证券账户 stock account

证券登记结算机构为投资者设立的，记录证券及证券衍生品种持有及其变动情况的载体。

注：根据用途不同证券账户可分为A股账户、B股账户、A股信用账户、股转系统账户、基金账户、衍生品合约账户等。

4 数据类别及类型

4.1 数据类别

本部分覆盖所有场内业务，暂不覆盖场外业务。主要包括四大类业务数据：投资者账户数据、经纪业务数据、信用业务数据、衍生品业务数据，数据类别内容见表1。各数据类别涉及的数据项见附录A，数据项的代码取值见附录B。

表 1 数据类别

序号	数据	说明	数据类别
1	投资者账户数据	与投资者相关的基本信息，如客户基本信息、资金及证券账户等数据	投资者信息数据
			投资者资金账号数据
			投资者证券账号数据
			投资者存管账号数据
2	经纪业务数据	证券公司接受客户委托，代理客户买卖证券的标准化证券业务	投资者资金余额数据
			投资者证券余额数据
			投资者限售股余额数据
3	信用业务数据	股票质押业务、约定购回业务、两融业务等产生负债的证券业务	投资者股票质押合同数据
			投资者约定购回合同数据
			投资者债券质押式回购数据
			投资者两融合同数据
			投资者两融资金余额数据
			投资者两融证券余额数据
			投资者两融合约负债数据
			投资者两融资产负债数据
			投资者融券权益补偿数据
4	衍生品业务数据	个股期权等标的证券业务	投资者期权资金余额数据
			投资者期权持仓数据

4.2 数据类型

数据类型说明：
——C，字符型。如一码通账户编码，C50；
——N，数值型。其长度不包含小数点，可参与数值计算。字段长度为 x，表示该字段最长为 x；字段长度为 (x, y)，表示该字段最长为 x，保留 y 位小数，如资金账户余额，N (17, 2)。

5 数据内容及格式

5.1 投资者账户数据

5.1.1 投资者信息数据

投资者信息数据内容和格式见表2。

表 2 投资者信息数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		客户一码通标识代码
3	YMTZHZTDM	一码通账户状态代码	C	2	N	DIM01	
4	KHRQ	一码通开户日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
5	XHRQ	一码通销户日期	C	8	Y		格式: YYYYMMDD, 非注销状态为空。
6	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
7	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
8	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码, 如无则填客户资金账户账号, 在单客户多银行模式下, 如无客户编码, 需填写主资金账户账号。
9	KHBMKHRQ	客户编码开户日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
10	KHBMXHRQ	客户编码销户日期	C	8	Y		格式: YYYYMMDD, 非销户状态为空。
11	KHMC	客户名称	C	120	N		投资者开户时记录的客户名称。
12	KHLBDM	客户类别代码	C	1	N	DIM02	
13	KHZTDM	客户状态代码	C	2	N	DIM03	
14	KHZJLXDM	客户证件类型代码	C	2	N	DIM04	
15	KHZJHM	客户证件号码	C	60	N		
16	ZJYXQJZRQ	证件有效期截止日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
17	KHDEZJLXDM	客户第二证件类型代码	C	2	Y	DIM04	
18	KHDEZJHM	客户第二证件号码	C	60	Y		
19	DEZJYXQJZRQ	第二证件有效期截止日期	C	8	Y		当“KHDEZJHM 客户第二证件号码”不为空时, 不能为空。
20	GJDQDM	国籍地区代码	C	3	Y		根据 GB/T 2659—2000 中的 3 位字符代码, 确定的国籍地区代码, 如 CHN 中国。
21	KHXLDM	客户学历代码	C	2	Y	DIM05	根据 GB/T 4658—2006 确定的客户学历代码。
22	KHZYDM	客户职业代码	C	2	Y	DIM06	投资者在券商登记的职业信息。
23	FDDBRXM	法定代表人姓名	C	120	Y		
24	FDDBRZJHM	法定代表人证件号码	C	60	Y		
25	JBRXM	经办人姓名	C	120	Y		
26	JBRZJHM	经办人证件号码	C	60	Y		
27	ZCDZ	注册地址	C	120	Y		

表2 投资者信息数据的内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
28	LXDZ	联系地址	C	120	Y		投资者在券商登记的联系地址。
29	YZBM	邮政编码	C	20	N		投资者在券商登记的邮政编码。
30	LXDH	联系电话	C	30	N		投资者在券商登记的联系电话号码。
31	YDDH	移动电话	C	30	N		投资者在券商登记的移动电话号码。
32	DZYX	电子邮箱	C	96	Y		投资者在券商登记的电子邮箱地址。

5.1.2 投资者资金账号数据

投资者资金账号数据内容和格式见表3。

表3 投资者资金账号数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	Y		如果是一码通客户，填写一码通账户账号。
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBB	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
7	ZZHBZ	主账户标志	C	2	N	DIM07	
8	ZJZHYTDM	资金账户用途代码	C	1	N	DIM08	
9	ZJZHZTDM	资金账户状态代码	C	2	N	DIM09	
10	ZHCGDXDM	资金账户存管类型代码	C	1	N	DIM10	
11	KHRQ	开户日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
12	XHRQ	销户日期	C	8	Y		格式：YYYYMMDD，非注销状态为空。

5.1.3 投资者证券账号数据

投资者证券账户数据内容和格式见表4。

表 4 投资者证券账号数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
7	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
8	ZQZHLBDM	证券账户类别代码	C	2	N	DIM11	
9	ZQZHZTDM	证券账户状态代码	C	2	N	DIM12	
10	ZQZHKHFSDM	证券账户开户方式代码	C	2	Y	DIM13	
11	KHRQ	开户日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
12	XHRQ	销户日期	C	8	Y		格式：YYYYMMDD，非注销状态为空。

5.1.4 投资者存管账号数据

投资者存管账号数据内容和格式见表5。

表 5 投资者存管账号数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	YHJGBM	银行机构编码	C	7	N		根据 JR/T 0046—2009 确定的银行机构编码。
6	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
7	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
8	YHZZ	银行账号	C	32	N		银行卡账号

表5 投资者存管账号数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
9	ZZHBZ	主账户标志	C	2	N	DIM07	
10	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
11	CGZTDM	存管状态代码	C	1	N	DIM15	

5.2 经纪业务数据

5.2.1 投资者资金余额数据

投资者资金余额数据内容和格式见表6。

表6 投资者资金余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号。
7	ZJZHYTDM	资金账户用途代码	C	1	N	DIM08	资金账户用途为一般资金账户。
8	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
9	ZJZHYE	资金账户余额	N	(17, 2)	N		不包含冻结资金。
10	DJJE	资金冻结金额	N	(17, 2)	N		不包含委托产生的冻结资金情况。
11	WDZJE	未到账金额	N	(17, 2)	N		该账户所有但还未到账的资金金额。包括自有证券、质押及冻结证券在股权登记日之后产生的红利金额和账户资金余额产生的未到账利息。

5.2.2 投资者证券余额数据

投资者证券余额数据内容和格式见表7。

表 7 投资者证券余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBB	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
7	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
8	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
9	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
10	ZQLBDM	证券类别代码	C	5	N	DIM17	
11	ZHCYSL	账户持有数量	N	(17, 2)	N		
12	DJS	冻结数量	N	(17, 2)	N		不包含委托产生的冻结情况。
13	DQS	账户当前市值	N	(17, 2)	N		
14	DJS	冻结市值	N	(17, 2)	N		
15	WDZSL	未到账数量	N	(17, 2)	N		该股股票所有还未到账但所有权已经属于账户的股票，如红股、配股、增发股票等。

5.2.3 投资者限售股余额数据

投资者限售股余额数据内容和格式见表8。

表 8 投资者限售股余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	Y		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBB	证券公司营业部编码	C	6	Y		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	Y		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。

表8 投资者限售股余额数据的内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	Y		客户资金账户账号
7	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
8	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
9	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
10	QSRQ	限售起始日期	C	8	Y		格式: YYYYMMDD
11	JZRQ	限售截止日期	C	8	Y		格式: YYYYMMDD
12	XSSL	限售数量	N	(17, 2)	N		
13	XSYDM	限售原因代码	C	12	Y	DIM18	

5.3 信用业务数据

5.3.1 投资者股票质押合同数据

投资者股票质押合同数据内容和格式见表9, 该数据内容为证券市场投资者信用业务下的股票质押未了结合同及当日了结合同数据。

表9 投资者股票质押合同数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSB	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	JYRQ	交易日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
5	ZQGSYBB	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码
6	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码, 如无则填客户资金账户账号, 在单客户多银行模式下, 如无客户编码, 需填写主资金账户账号。
7	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
8	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
9	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
10	HTBH	合同编号	C	32	N		股票质押合同编号或补充质押时的合同编号。
11	GLHTBH	关联合同编号	C	32	N		补充质押时指向的主合同编号, 若没有补充质押则填 0。
12	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	

表9 投资者股票质押合同数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
13	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
14	ZQLB	证券类别代码	C	5	N	DIM17	
15	HYZTDM	合约状态代码	C	2	N	DIM19	
16	WTSL	委托数量	N	(17, 2)	N		初始交易数量
17	WTJE	委托金额	N	(17, 2)	N		初始交易金额
18	CSRZLL	初始融资利率	N	(10, 8)	N		预期购回利率
19	CSGHJE	初始购回金额	N	(17, 2)	N		即预期购回金额，初始购回金额=初始交易金额+应计融资利息。
20	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	N		初始购回日期。格式：YYYYMMDD
21	SJRZLL	实际融资利率	N	(10, 8)	N		实际购回利率，未购回时可填0。
22	GHJE	购回金额	N	(17, 2)	N		即实际购回金额，为投资者进行股票质押业务时的负债。购回金额=初始交易金额+应计融资利息-已偿还融资金额及利息。
23	GHRQ	购回日期	C	8	N		实际购回日期，格式：YYYYMMDD。未购回时可填0。
24	QSRQ	签署日期	C	8	N		签约日期。格式：YYYYMMDD。
25	ZJYT	资金用途	C	128	N		融资用途
26	RCFZQZHB	融出方证券账户编码	C	20	N		融资出资方证券账户账号
27	DBZSJ	担保折算价	N	(10, 4)	N		担保证券折算价格
28	HGSL	红股数量	N	(17, 2)	N		担保证券红股数量
29	HLJE	红利金额	N	(17, 2)	N		担保证券红利金额
30	YJLX	已结利息	N	(17, 2)	N		已经结算的利息
31	WJLX	未结利息	N	(17, 2)	N		仍未结算的利息
32	FXRQ	罚息开始日期	C	8	Y		格式：YYYYMMDD
33	FX	罚息	N	(17, 2)	Y		
34	YJYSL	已解押数量	N	(17, 2)	Y		
35	DQZYSL	当前质押数量	N	(17, 2)	N		DQZYSL=WTSL-YJYSL+HGSL
36	ZSBL	折算比例	N	(10, 2)	N		担保证券折算比率
37	LYBZBL	履约保障比例	N	(10, 4)	N		关注处置比率
38	JJBL	警戒比例	N	(10, 4)	N		警戒处置比率
39	CZBL	处置比例	N	(10, 4)	N		强行处置比率

5.3.2 投资者约定购回合同数据

投资者约定购回合同数据内容和格式见表10，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的约定购回未了结合同及当日了结合同数据。

表 10 投资者约定购回合同数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	JYRQ	交易日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
5	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
6	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
7	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
8	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
9	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
10	HTBH	合同编号	C	32	N		约定购回合同编号或补充质押的合同编号。
11	GLHTBH	关联合同编号	C	32	N		补充质押时指向的主合同编号，若没有补充质押则填 0。
12	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
13	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
14	ZQLBDM	证券类别代码	C	5	N	DIM17	
15	HYZTDM	合约状态代码	C	2	N	DIM19	
16	WTSL	委托数量	N	(17, 2)	N		初始交易数量
17	WTJE	委托金额	N	(17, 2)	N		初始交易金额
18	CSRZLL	初始融资利率	N	(10, 8)	N		预期购回利率
19	CSGHJE	初始购回金额	N	(17, 2)	N		即预期购回金额；初始购回金额=初始交易金额+应计融资利息。
20	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	N		购回日期。格式：YYYYMMDD。
21	SJRZLL	实际融资利率	N	(10, 8)	N		实际购回利率，未购回时可填 0。
22	GHJE	购回金额	N	(17, 2)	N		即实际购回金额，为投资者进行约定购回业务时的负债。购回金额=初始交易金额+应计融资利息-已偿还融资金额及利息。
23	GHRQ	购回日期	C	8	N		实际购回日期，格式：YYYYMMDD。未购回时可填 0。
24	QSRQ	签署日期	C	8	N		签约日期。格式：YYYYMMDD。
25	ZJYT	资金用途	C	128	N		融资用途

表 10 投资者约定购回合同数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
26	RCFZQZHB	融出方证券账户编码	C	20	N		融资出资方证券账户账号
27	DBZSJ	担保折算价	N	(10, 4)	N		担保证券折算价格
28	HGSL	红股数量	N	(17, 2)	N		担保证券红股数量
29	HLJE	红利金额	N	(17, 2)	N		担保证券红利金额
30	YJLX	已结利息	N	(17, 2)	N		已经结算的利息
31	WJLX	未结利息	N	(17, 2)	N		仍未结算的利息
32	ZSBL	折算比例	N	(10, 2)	N		担保证券折算比率
33	LYBZBL	履约保障比例	N	(10, 4)	N		关注处置比率
34	JJBL	警戒比例	N	(10, 4)	N		警戒处置比率
35	CZBL	处置比例	N	(10, 4)	N		强行处置比率

5.3.3 投资者债券质押式回购数据

投资者债券质押式回购数据内容和格式见表 11，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的未了结债券质押式回购及债券质押式协议回购等质押式回购合同数据。

表 11 投资者债券质押式回购合同数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	JYRQ	交易日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
5	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
6	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
7	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户资金账户账号
8	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户证券账户账号
9	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
10	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
11	HGFXDM	回购方向代码	C	1	N	DIM28	
12	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码；填写债券质押回购业务对应的标准券或者质押券的代码。

表 11 投资者债券质押式回购合同数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
13	ZQLBDM	证券类别代码	C	5	N	DIM17	
14	WTSL	委托数量	N	(17, 2)	N		委托金额对应的标准券数量
15	WTJE	委托金额	N	(17, 2)	N		
16	HYSJLL	合约实际利率	N	(10, 8)	N		实际的回购利率，若为协议回购合同则填交易双方协商约定的回购利率。
17	GHJE	购回金额	N	(17, 2)	N		若为正回购方，填报委托金额与应付利息之和；若为逆回购方，填报委托金额与应收利息之和。
18	GHRQ	购回日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
19	HYZTDM	合约状态代码	C	2	N	DIM19	
20	DFXWDM	对方席位代码	C	32	N		交易对手方的席位号

5.3.4 投资者两融合同数据

投资者两融合同数据内容和格式见表 12，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的融资融券合同信息，反映证券公司在融资融券系统中新增签约客户或原签约客户相关资料记录。

表 12 投资者两融合同数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHBDM	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
5	HTQXMSDM	合同期限模式代码	C	1	N	DIM20	
6	HTZTDM	合同状态代码	C	1	N	DIM21	
7	HTBH	合同编号	C	20	N		系统中的合同编号。
8	HTSXRQ	合同生效日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
9	HTSXRQ	合同失效日期	C	8	Y		格式：YYYYMMDD，长期合同填写 20991231。
10	XYJBDM	信用级别代码	C	8	N		填报系统中的信用级别代码（字母或者数字）。
11	XYDF	信用得分	N	10	N		填报系统中的融资融券征信评分。

表 12 投资者两融合同数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
12	RZCSBZJBL	融资初始保证金比例	N	(16, 4)	N		如：90%，用 0.9 表示，填写最低融资初始保证金比例。
13	RQCSBZJBL	融券初始保证金比例	N	(16, 4)	N		如：90%，用 0.9 表示，填写最低融券初始保证金比例。
14	SXED	授信额度	N	(16, 2)	N		公司审核客户时的初始授信，即对该客户的最大授信额度。
15	SXRQ	授信日期	C	8	N		即客户开通两融业务的日期，格式：YYYYMMDD。
16	RZSX	融资上限	N	(16, 2)	N		如没有融资上限，金额同授信额度。
17	RQSX	融券上限	N	(16, 2)	N		如没有融券上限，金额同授信额度。

5.3.5 投资者两融资金余额数据

投资者两融资金余额数据内容和格式见表13,该数据内容为证券市场投资者信用业务下的信用资金账户的资金余额信息。

表 13 投资者两融资金余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户信用资金账户账号。
7	ZJZHYTDM	资金账户用途代码	C	1	N	DIM08	资金账户用途为信用资金账户。
8	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
9	ZJZHYE	资金账户余额	N	(17, 2)	N		包括冻结资金但不包括未到账金额，可为负数。
10	DJJE	资金冻结金额	N	(17, 2)	N		为融券卖出的冻结资金金额。

表 13 投资者两融资金余额数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
11	WDZJE	未到账金额	N	(17, 2)	N		应计入客户资产但实际未到账的资产，包括自有证券、担保证券及余券等产生的未到账的资金红利。

5.3.6 投资者两融证券余额数据

投资者两融证券余额数据内容和格式见表 14，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的信用证券账户的证券余额信息。

表 14 投资者两融证券余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
6	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户信用资金账户账号
7	ZQZHB	证券账户编码	C	20	N		客户信用证券账户账号
8	ZQZHLBDM	证券账户类别代码	C	2	N	DIM11	
9	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
10	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
11	ZQLBDM	证券类别代码	C	5	N	DIM17	
12	ZHCYSL	账户持有数量	N	(17, 2)	N		清算完成后到账的证券数量，允许为零股。
13	DQSZ	账户当前市值	N	(17, 2)	N		清算后证券账户下实际的证券余额。
14	WDZSL	未到账数量	N	(17, 2)	N		该股股票所有还未到账但所有权已经属于账户的股票如红股、配股、增发股票等；还包括未归还的余券数量，余券产生的未到账的红股、配股及担保证券产生的未到账的红股、配股等。

5.3.7 投资者两融合约负债数据

投资者两融合约负债数据内容和格式见表 15，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的融资融券合约信息，反映证券公司在融资融券系统中开设的所有签约客户的当日了结合约以及截至当日日终未了结的融资合约或者融资本金已归还但利息尚未了结的合约，截至当日日终未了结的融券仓单或者融券数量已归还但利息尚未了结的合约记录，同时也能反映出信用业务下的负债信息。

表 15 投资者两融合约负债数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHBM	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
5	ZJZHBM	资金账户编码	C	20	N		客户信用资金账户账号
6	ZQZHBM	证券账户编码	C	20	N		客户信用证券账户账号
7	RZFXDM	融资方向代码	C	1	N	DIM22	融资买入或者融券卖出
8	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
9	CLRQ	成立日期	C	8	N		两融合约成立日期，格式：YYYYMMDD。
10	CLSJ	成立时间	C	6	N		两融合约成立时间，格式：HHMMSS。
11	KCDJHM	开仓单据号码	C	32	N		两融开仓合约编号。
12	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
13	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
14	HYLL	合约利率	N	(10, 6)	N		两融合约年利率
15	CJJG	成交价格	N	(16, 2)	N		两融成交时该笔合约的平均成交价格。
16	KCJE	开仓金额	N	(16, 2)	N		含佣金费用，指这笔融资合约的初始融资负债；若为融券合约，则填 0。开仓金额=偿还金额+融资金额。
17	CHJE	偿还金额	N	(16, 2)	N		累计偿还本金额，含佣金偿还部分；若为融券合约，则填 0。

表 15 投资者两融合约负债数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
18	RZJE	融资金额	N	(16, 2)	N		此仓单剩余融资本金负债金额，含佣金负债部分；若为融券合约，则填 0。
19	RZJYGF	融资交易规费	N	(16, 2)	N		代收的一级费用：如印花税、过户费、证管费等。
20	RZJYYJ	融资交易佣金	N	(16, 2)	N		券商收取的交易佣金费用。
21	RZLX	融资利息	N	(16, 2)	N		包含已结未付，未结利息和已结已付利息，若为融券合约，则填 0。
22	RQKCSL	开仓数量	N	(16, 2)	N		不包括融券也不包括权益券；若为融资合约，则填 0，开仓数量=偿还数量+融券数量。
23	RQCHSL	偿还数量	N	(16, 2)	N		不包括融券也不包括权益券；若为融资合约，则填 0。
24	RQSL	融券数量	N	(16, 2)	N		不包括融券也不包括权益券；若为融资合约，则填 0。
25	RQJE	融券金额	N	(16, 2)	N		此仓单剩余融券负债金额，含佣金负债部分；若为融资合约，则填 0。
26	RQFY	融券费用	N	(16, 2)	N		包含已结未付息费，未结息费和已结已付息费，为融资合约，则填 0。
27	YQFX	逾期罚息	N	(16, 2)	N		若不收取，则填 0。
28	WJXF	未结息费	N	(16, 2)	N		至终止日期累计未结息费，包括正常收取的利息中的未结息费和逾期罚息中的未结息费等。
29	YJWFXF	已结未付息费	N	(16, 2)	N		至终止日期累计已结未付息费，包括正常收取的利息中的已结未付息费和逾期罚息中的已结未付息费等。
30	YJYFXF	已结已付息费	N	(16, 2)	N		至终止日期累计已结已付息费，包括正常收取的利息中的已结已付息费和逾期罚息中的已结已付息费等。
31	QTFY	其他费用	N	(16, 2)	N		券商收取的其它收费，若无，则填 0。
32	LJBZ	了结标志	C	1	N	DIM23	
33	CDDQR	仓单到期日	C	8	N		格式：YYYYMMDD
34	BZZ	备注	C	40	Y		各类情况说明。

5.3.8 投资者两融资产负债数据

投资者两融资产负债数据的内容和格式见表 16，该数据内容为证券市场投资者客户信用业务下的融资融券资产负债信息。

表 16 投资者两融资产负债数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。
5	ZJZHB	资金账户编码	C	20	N		客户信用资金账户账号。
6	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
7	ZJYE	资金余额	N	(16, 2)	N		可为负数
8	WDZJE	未到账金额	N	(17, 2)	N		
9	ZQSZ	证券市值	N	(16, 2)	N		
10	RZFB	融资负债	N	(16, 2)	N		含利费佣金等。
11	RQFB	融券负债	N	(16, 2)	N		客户融券负债=融券金额+融券费用+融券其他费用
12	WCDBL	维持担保比例	N	(16, 4)	N		$(7+8+9)/(10+11)$
13	BZJKYYE	保证金可用余额	N	(16, 2)	N		可以为负数。

5.3.9 投资者融券权益补偿数据

投资者融券权益补偿数据的内容和格式见表 17，该数据内容为证券市场投资者信用业务下的融券权益补偿信息。

表 17 投资者融券权益补偿数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司 8 位机构编码。
4	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码，如无则填客户资金账户账号，在单客户多银行模式下，如无客户编码，需填写主资金账户账号。

表 17 投资者融券权益补偿数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
5	ZJZHBM	资金账户编码	C	20	N		客户信用资金账户账号
6	ZQZHBM	证券账户编码	C	20	N		客户信用证券账户账号
7	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
8	FSRQ	发生日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
9	KCDJHM	开仓单据号码	C	32	N		发生权益的融券仓单号码。
10	QYRQDJHM	权益融券单据号码	C	32	Y		复权仓单号码，可与开仓单据号码一致，当补偿类型为红利或资金补偿数据时，可为空。
11	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	
12	ZQDM	证券代码	C	12	N		证券交易所批准规定的证券产品代码。
13	RQSL	融券数量	N	(16, 2)	N		一般情况下为登记日融券数量若证券公司合同另行约定的遵从其约定。
14	BCLXDM	补偿类型代码	C	2	N	DIM24	
15	BCJE	补偿金额	N	(16, 2)	N		权益补偿金额
16	BCSL	补偿数量	N	(16, 2)	N		权益补偿数量
17	CHJE	偿还金额	N	(16, 2)	N		对应 BCJE 的偿还。
18	CHSL	偿还数量	N	(16, 2)	N		对应 BCSL 的偿还。
19	QYLSH	权益流水号	C	30	N		证券公司内部的权益记录编号。
20	QYRZDJHM	权益融资单据号码	C	32	Y		复权仓单号码，当补偿类型为证券时，可为空。

5.4 衍生品业务数据

5.4.1 投资者期权资金余额数据

投资者期权资金余额数据的内容和格式见表 18，该数据内容为证券市场投资者证券衍生品业务下的个股期权资金账户资金余额信息。

表 18 投资者期权资金余额数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式：YYYYMMDD
2	YMTZHBM	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。

表 18 投资者期权资金余额数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码,如无则填客户资金账户账号,在单客户多银行模式下,如无客户编码,需填写主资金账户账号。
6	ZJZHBM	资金账户编码	C	20	N		客户衍生品业务资金账户账号。
7	ZJZHYTDM	资金账户用途代码	C	1	N	DIM08	资金账户用途为衍生品资金账户。
8	BZDM	币种代码	C	3	N	DIM14	根据 GB/T 12406—2008 确认的币种代码。
9	ZJZHYE	资金账户余额	N	(17, 2)	N		不包含冻结资金。
10	DJJE	资金冻结金额	N	(17, 2)	N		不包含委托产生的冻结资金情况,冻结金额为证券公司向客户收取的维持保证金金额。
11	WDZJE	未到账金额	N	(17, 2)	N		包括该账户资金余额产生的未到账利息等还未到账的资金金额。

5.4.2 投资者期权持仓数据

投资者期权持仓数据的内容和格式见表 19, 该数据内容为证券市场投资者证券衍生品业务下的个股期权持仓信息。

表 19 投资者期权持仓数据的内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	SJRQ	数据日期	C	8	N		格式: YYYYMMDD
2	YMTZHBM	一码通账户编码	C	50	N		一码通账户代码
3	ZQGSBM	证券公司编码	C	8	N		证监会确定的证券公司机构编码。
4	ZQGSYYBBM	证券公司营业部编码	C	6	N		证券公司确定的营业部代码。
5	KHBM	客户编码	C	20	N		客户唯一标识代码,如无则填客户资金账户账号,在单客户多银行模式下,如无客户编码,需填写主资金账户账号。
6	ZJZHBM	资金账户编码	C	20	N		客户衍生品业务资金账户账号。
7	ZQZHBM	证券账户编码	C	20	N		客户衍生品合约证券账户账号。
8	SCDM	市场代码	C	2	N	DIM16	

表 19 投资者期权持仓数据的内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
9	QQHYDM	期权合约代码	C	12	N		期权合约的编号。
10	QQHYLXDM	期权合约类型代码	C	5	N	DIM25	认购期权或者是认沽期权。
11	QQCCLBDM	期权持仓类别代码	C	5	N	DIM26	权利方或者是义务方。
12	ZHCYSL	账户持有数量	N	(17, 2)	N		
13	ZHKYSL	账户可用数量	N	(17, 2)	N		
14	DJSL	冻结数量	N	(17, 2)	N		不包含委托产生的冻结情况。
15	XQJG	行权价格	N	(16, 2)	N		期权合约所约定的购买或出售标的证券的价格。
16	BDZQDM	标的证券代码	C	12	N		
17	BDBZ	备兑标志	C	1	N	DIM27	

附 录 A
(规范性附录)
数据字典

数据字典内容见表A.1。

表 A.1 数据字典

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
1	SJRQ	数据日期	C	8	
2	YMTZHB	一码通账户编码	C	50	
3	YMTZHTDM	一码通账户状态代码	C	2	DIM01
4	KHRQ	一码通开户日期	C	8	
5	XHRQ	一码通销户日期	C	8	
6	ZQGSB	证券公司编码	C	8	
7	ZQGSYB	证券公司营业部编码	C	6	
8	KHB	客户编码	C	20	
9	KHBMKHRQ	客户编码开户日期	C	8	
10	KHBMXHRQ	客户编码销户日期	C	8	
11	KHMC	客户名称	C	120	
12	KHLBDM	客户类别代码	C	1	DIM02
13	KHZTDM	客户状态代码	C	2	DIM03
14	KHZJLXDM	客户证件类型代码	C	2	DIM04
15	KHZQH	客户证件号码	C	60	
16	ZJYXQJZRQ	证件有效期截止日期	C	8	
17	ZJLX2	客户第二证件类型代码	C	2	DIM04
18	KHDEZJH	客户第二证件号码	C	60	
19	DEZJYXQJZRQ	第二证件有效期截止日期	C	8	
20	GJDQDM	国籍地区代码	C	3	
21	KHXLDM	客户学历代码	C	2	DIM05
22	KHZYDM	客户职业代码	C	2	DIM06
23	FDDBRXM	法定代表人姓名	C	120	
24	FDDBRZJH	法定代表人证件号码	C	60	
25	JBRXM	经办人姓名	C	120	
26	JBRZJH	经办人证件号码	C	60	
27	ZCDZ	注册地址	C	120	
28	LXDZ	联系地址	C	120	
29	YZB	邮政编码	C	20	
30	LXDH	联系电话	C	30	
31	YDDH	移动电话	C	30	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
32	DZYX	电子邮箱	C	96	
33	ZJZHBM	资金账户编码	C	20	
34	ZZHBZ	主账户标志	C	2	DIM07
35	ZJZHYTDM	资金账户用途代码	C	1	DIM08
36	ZJZHZTDM	资金账户状态代码	C	2	DIM09
37	ZHCGLXDM	资金账户存管类型代码	C	1	DIM10
38	KHRQ	开户日期	C	8	
39	XHRQ	销户日期	C	8	
40	ZQZHBM	证券账户编码	C	20	
41	ZQZHZTDM	证券账户状态代码	C	2	DIM12
42	ZQZHKHFSDM	证券账户开户方式代码	C	2	DIM13
43	YHJGBM	银行机构编码	C	7	
44	YHZH	银行账号	C	32	
45	BZDM	币种代码	C	3	DIM14
46	CGZTDM	存管状态代码	C	1	DIM15
47	ZJZHYE	资金账户余额	N	(17, 2)	
48	DJJE	资金冻结金额	N	(17, 2)	
49	WDZJE	未到账金额	N	(17, 2)	
50	SCDM	市场代码	C	2	DIM16
51	ZQDM	证券代码	C	12	
52	ZQLBDM	证券类别代码	C	5	DIM17
53	ZHCYSL	账户持有数量	N	(17, 2)	
54	DJSL	冻结数量	N	(17, 2)	
55	DQSZ	账户当前市值	N	(17, 2)	
56	DJSZ	冻结市值	N	(17, 2)	
57	WDZSL	未到账数量	N	(17, 2)	
58	QSRQ	限售起始日期	C	8	
59	JZRQ	限售截止日期	C	8	
60	XSSL	限售数量	N	(17, 2)	
61	XSYYDM	限售原因代码	C	12	DIM18
62	JYRQ	交易日期	C	8	
63	HTBH	合同编号	C	32	
64	GLHTBH	关联合同编号	C	32	
65	HYZTDM	合约状态代码	C	2	DIM19
66	WTSL	委托数量	N	(17, 2)	
67	WTJE	委托金额	N	(17, 2)	
68	CSRZLL	初始融资利率	N	(10, 8)	
69	CSGHJE	初始购回金额	N	(17, 2)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
70	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	
71	SJRZLL	实际融资利率	N	(10, 8)	
72	GHJE	购回金额	N	(17, 2)	
73	GHRQ	购回日期	C	8	
74	QSRQ	签署日期	C	8	
75	ZJYT	资金用途	C	128	
76	RCFZQZHB	融出方证券账户编码	C	20	
77	DBZSJ	担保折算价	N	(10, 4)	
78	HGSL	红股数量	N	(17, 2)	
79	HLJE	红利金额	N	(17, 2)	
80	YJLX	已结利息	N	(17, 2)	
81	WJLX	未结利息	N	(17, 2)	
82	FXRQ	罚息开始日期	C	8	
83	FX	罚息	N	(17, 2)	
84	YJYSL	已解押数量	N	(17, 2)	
85	DQZYS	当前质押数量	N	(17, 2)	
86	ZSBL	折算比例	N	(10, 2)	
87	LYBZBL	履约保障比例	N	(10, 4)	
88	JJBL	警戒比例	N	(10, 4)	
89	CZBL	处置比例	N	(10, 4)	
90	HTQXMSDM	合同期限模式代码	C	1	DIM20
91	HTZTDM	合同状态代码	C	1	DIM21
92	HTSXRQ	合同生效日期	C	8	
93	HTSXRQ	合同失效日期	C	8	
94	XYJBDM	信用级别代码	C	8	
95	XYDF	信用得分	N	10	
96	RZCSBJBL	融资初始保证金比例	N	(16, 4)	
97	RQCSBJBL	融券初始保证金比例	N	(16, 4)	
98	SXED	授信额度	N	(16, 2)	
99	SXRQ	授信日期	C	8	
100	RZSX	融资上限	N	(16, 2)	
101	RQSX	融券上限	N	(16, 2)	
102	RZFXDM	融资方向代码	C	1	DIM22
103	ZQZHLBDM	证券账户类别代码	C	2	DIM11
104	CLRQ	成立日期	C	8	
105	CLSJ	成立时间	C	6	
106	KCDJHM	开仓单据号码	C	32	
107	HYLL	合约利率	N	(10, 6)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
108	CJJG	成交价格	N	(16, 2)	
109	KCJE	开仓金额	N	(16, 2)	
110	RZJE	融资金额	N	(16, 2)	
111	RZJYGF	融资交易规费	N	(16, 2)	
112	RZJYYJ	融资交易佣金	N	(16, 2)	
113	RZLX	融资利息	N	(16, 2)	
114	RQKCSL	开仓数量	N	(16, 2)	
115	RQCHSL	偿还数量	N	(16, 2)	
116	RQSL	融券数量	N	(16, 2)	
117	RQJE	融券金额	N	(16, 2)	
118	RQFY	融券费用	N	(16, 2)	
119	YQFX	逾期罚息	N	(16, 2)	
120	WJXF	未结息费	N	(16, 2)	
121	YJWF XF	已结未付息费	N	(16, 2)	
122	YJYFXF	已结已付息费	N	(16, 2)	
123	QTFY	其他费用	N	(16, 2)	
124	LJBZ	了结标志	C	1	DIM23
125	CDDQR	仓单到期日	C	8	
126	BZZ	备注	C	40	
127	ZJYE	资金余额	N	(16, 2)	
128	ZQSZ	证券市值	N	(16, 2)	
129	RZ FZ	融资负债	N	(16, 2)	
130	RQ FZ	融券负债	N	(16, 2)	
131	WCDBBL	维持担保比例	N	(16, 4)	
132	BZJKYYE	保证金可用余额	N	(16, 2)	
133	FSRQ	发生日期	C	8	
134	QYRQDJHM	权益融券单据号码	C	32	
135	BCLXDM	补偿类型代码	C	2	DIM24
136	QYLSH	权益流水号	C	30	
137	QYRZDJHM	权益融资单据号码	C	32	
138	BCJE	补偿金额	N	(16, 2)	
139	BCSL	补偿数量	N	(16, 2)	
140	CHJE	偿还金额	N	(16, 2)	
141	CHSL	偿还数量	N	(16, 2)	
142	QQHYDM	期权合约代码	C	12	
143	QQHYLXDM	期权合约类型代码	C	5	DIM25
144	QQCCLBDM	期权持仓类别代码	C	5	DIM26
145	ZHKYSL	账户可用数量	N	(17, 2)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
146	XQJG	行权价格	N	(16, 2)	
147	BDZQDM	标的证券代码	C	12	
148	BDBZ	备兑标志	C	1	DIM27
149	HGFXDM	回购方向代码	C	1	DIM28
150	HYSJLL	合约实际利率	N	(10, 8)	
151	DFXWDM	对方席位代码	C	32	

附 录 B
(规范性附录)
代码取值及描述

B.1 一码通账户状态代码

一码通账户状态代码取值内容见表B.1。

表 B.1 一码通账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
一码通账户状态代码/DIM01	0	正常
	1	注销

B.2 客户类别代码

客户类别代码取值内容见表B.2。

表 B.2 客户类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
客户类别代码/DIM02	0	个人
	1	机构
	2	产品

B.3 客户状态代码

客户状态代码取值内容见表B.3。

表 B.3 客户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
客户状态代码/DIM03	00	正常
	01	销户

B.4 证件类型代码

证件类型代码取值见表B.4。

表 B.4 证件类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证件类型代码/DIM04	01	身份证
	02	护照

表 B.4 证件类型代码取值(续)

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证件类型代码/DIM04	03	港澳居民来往内地通行证
	04	台湾居民来往大陆通行证
	05	军官证
	06	解放军士兵证
	07	武警士兵证
	08	户口本
	09	解放军文职干部证
	10	武警文职干部证
	11	警官证
	12	社会保障号
	13	外国人永久居留证
	14	外国护照
	15	临时身份证
	16	其他人员证件
	17	社团法人注册登记证书
	18	机关事业法人成立批文
	19	批文
	20	军队凭证
	21	武警凭证
	22	基金会凭证
	23	特殊法人注册号
	24	统一社会信用代码
	25	行政机关
	26	社会团体
	27	下属机构（具有主管单位批文号）
	28	其他机构证件号
	29	营业执照（产品管理人营业执照）
	30	登记证书
	31	其他

B.5 客户学历代码

客户学历代码取值内容见表B.5。

表 B.5 客户学历代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
客户学历代码/DIM05	01	博士
	02	硕士
	03	学士
	04	大专
	05	中专
	06	高中
	07	初中及其以下
	99	其他

B.6 主账户标志

主账户标志代码取值内容见表B.6。

表 B.6 主账户标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
主账户标志/DIM07	00	是
	01	否

B.7 客户职业代码

客户职业代码内容见表B.7。

表 B.7 客户职业代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
客户职业代码/DIM06	01	文教科卫专业人员
	02	党政(在职, 离退休)机关干部
	03	企事业单位干部
	04	行政企事业单位工人
	05	农民
	06	个体
	07	无业
	08	军人
	09	学生
	10	证券从业人员
	99	其他

B.8 资金账户用途代码

资金账户用途代码取值内容见表B.8

表 B.8 资金账户用途代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
资金账户用途代码/DIM08	0	一般资金账户
	1	衍生品资金账户
	2	信用资金账户
	9	其他

B.9 资金账户状态代码

资金账户状态代码取值内容见表B.9。

表 B.9 资金账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
资金账户状态代码/DIM09	00	正常
	01	锁定
	02	冻结
	03	挂失
	04	注销

B.10 资金账户存管类型代码

资金账户存管类型代码取值内容见表B.10。

表 B.10 资金账户存管类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
资金账户存管类型代码/DIM10	0	三方存管
	1	非三方存管

B.11 证券账户类别代码

证券账户类别代码取值内容见表B.11。

表 B.11 证券账户类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券账户类别代码/DIM11	01	沪市 A 股证券账户（含港股通账户）
	02	深市 A 股证券账户（含港股通账户）
	03	沪市 B 股证券账户
	04	深市 B 股证券账户

表 B.11 证券账户类别代码取值(续)

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券账户类别代码/DIM11	05	沪市基金账户
	06	深市基金账户
	07	沪市其他证券账户
	08	深市其他证券账户
	09	全国中小企业股份转让系统账户
	12	沪市衍生品合约账户
	13	深市衍生品合约账户
	14	沪 A 信用证券账户
	15	深 A 信用证券账户
	99	其他

B.12 证券账户状态代码

证券账户状态代码取值内容见表B.12。

表 B.12 证券账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券账户状态代码/DIM12	00	正常
	01	中止交易
	02	冻结
	03	挂失
	04	注销
	05	休眠

B.13 证券账户开户方式代码

证券账户开户方式代码取值内容见表B.13。

表 B.13 证券账户开户方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券账户开户方式代码/DIM13	00	柜台开户
	01	见证开户
	02	网上开户
	03	手机开户
	99	其他

B.14 币种代码

币种代码取值内容见表B.14。

表 B.14 币种代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
币种代码/DIM14	CNY	人民币
	USD	美元
	HKD	港币

B.15 存管状态代码

存管状态代码取值内容见表B.15。

表 B.15 存管状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
存管状态代码/DIM15	0	正常（包括指定和预指定状态）
	1	销户（撤指定状态）
	2	冻结
	3	销户
	9	挂失

B.16 市场代码

市场代码取值内容见表B.16。

表 B.16 市场代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
市场代码/DIM16	01	上海 A 股市场
	02	上海 B 股市场
	03	深圳 A 股市场
	04	深圳 B 股市场
	05	沪港通下的港股通市场
	06	全国中小企业股份转让系统
	12	深港通下的港股通市场
	99	其他

B.17 证券类别代码

证券类别代码取值内容见表B.17。

表 B.17 证券类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券类别代码/DIM17	01	普通股票
	02	配股

表 B.17 证券类别代码取值(续)

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券类别代码/DIM17	03	配售股
	04	标准(普通)投资基金/共同基金
	05	交易型开放式指数基金(ETF)
	06	普通债券
	07	股票质押式回购
	08	债券质押式回购/协议回购
	09	约定购回
	10	融资融券
	11	期货
	12	期权
	13	权证
	14	资产支持债券
	15	其他

B.18 限售原因代码

限售股限售原因代码取值内容见表B.18。

表 B.18 限售原因代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
限售原因代码/DIM18	1	股改限售股
	2	新股限售股
	9	其他限售股

B.19 合约状态代码

两融合约状态代码取值内容见表B.19。

表 B.19 合约状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
合约状态代码/DIM19	01	未到期
	02	已到期未了结
	03	当日已了结
	04	违约处置中
	99	其他

B.20 合同期限模式代码

两融合同期限模式代码取值内容见表B. 20。

表 B. 20 合同期限模式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
合同期限模式代码/DIM20	1	长期
	2	定期

B. 21 合同状态代码

两融合同状态代码取值内容见表B. 21。

表 B. 21 合同状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
合同状态代码/DIM21	1	正常
	2	冻结
	3	失效（一般指过期未签约客户）
	9	其他

B. 22 融资方向代码

融资方向代码取值内容见表B. 22。

表 B. 22 融资方向代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
融资方向代码/DIM22	1	融资
	2	融券

B. 23 了结标志

两融合约了结标志代码取值内容见表B. 23。

表 B. 23 了结标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
了结标志/DIM23	0	未了结
	1	当日了结
	2	当日新开

B. 24 补偿类型代码

补偿类型代码取值内容见表B. 24。

表 B. 24 补偿类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
补偿类型代码/DIM24	01	资金权益（红利）
	02	股份权益（红股，配股等）
	03	股份权益现金补偿
	99	其他

B. 25 期权合约类型代码

期权合约类型代码取值内容见表B. 25。

表 B. 25 期权合约类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
期权合约类型代码/DIM25	C	认购期权
	P	认沽期权

B. 26 期权持仓类别代码

期权持仓类别代码取值内容见表B. 26。

表 B. 26 期权持仓类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
期权持仓类别代码/DIM26	0	权利方
	1	义务方

B. 27 备兑标志

备兑标志代码取值内容见表B. 27。

表 B. 27 备兑标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
备兑标志/DIM27	0	非备兑期权
	1	备兑期权

B. 28 回购方向代码

回购方向代码取值内容见表B. 28。

表 B. 28 回购方向代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
回购方向代码/DIM28	0	正回购
	1	逆回购

参 考 文 献

- [1] 中国证券登记结算有限责任公司. 中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则[Z]. 2014-08-25
-



中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0177.2—2020

证券期货业投资者权益相关数据的内容和 格式 第2部分：期货

Contents and formats of data on investors' rights and interests in the securities and
futures industry—Part2: Futures

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言..... II

1 范围..... 1

2 规范性引用文件..... 1

3 术语和定义..... 1

4 数据类别及类型..... 1

 4.1 数据类别..... 2

 4.2 数据类型..... 2

5 数据内容和格式..... 2

 5.1 投资者账户数据..... 2

 5.1.1 投资者基本资料数据..... 2

 5.1.2 投资者编码数据..... 4

 5.1.3 投资者结算账户数据..... 5

 5.2 持仓业务数据..... 5

 5.2.1 投资者期货持仓数据..... 5

 5.2.2 投资者期权持仓数据..... 6

 5.2.3 投资者现货持仓数据..... 7

 5.3 交割业务数据..... 8

 5.3.1 待交割数据..... 8

 5.3.2 交割数据..... 9

 5.4 结算业务资金数据..... 9

 5.4.1 投资者期货期权账户资金数据..... 9

 5.4.2 投资者现货账户资金数据..... 11

 5.4.3 投资者其他分项资金数据..... 12

 5.5 充抵业务数据..... 13

 5.5.1 货币充抵明细数据..... 13

 5.5.2 非货币充抵明细数据..... 13

附录 A （规范性附录） 数据字典..... 15

附录 B （规范性附录） 代码取值及描述..... 19

参考文献..... 26

前 言

JR/T 0177—2020《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式》分为3部分内容：

——第1部分：证券；

——第2部分：期货；

——第3部分：基金。

本部分为JR/T 0177—2020的第2部分。

本部分依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本部分由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本部分起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、中证信息技术服务有限责任公司、上海期货信息技术有限公司。

本部分主要起草人：姚前、刘铁斌、罗凯、王东明、周云晖、路一、周桢、罗璇、贾石、韩晓红、袁彦明、温雯、杨雪。

证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第2部分：期货

1 范围

本部分规定了期货业投资者权益数据的数据类别及类型、数据内容和格式等内容，数据内容和格式包括投资者账户数据、持仓业务数据、交割业务数据、结算业务资金数据及充抵业务数据等。

本部分适用于行业机构开展期货业投资者权益数据治理相关工作。

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，仅所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/T 4658—2006 学历代码

GB/T 2659—2000 世界各国和地区名称代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

GB/T 13497—1992 全国清算中心代码

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

期货投资者 futures investor

参与商品期货、金融期货、商品期权等场内期货市场的投资者。

注：主要有机构投资者和个人投资者。

3.2

交易编码 trading code

会员和客户进行期货交易的专用代码。由会员号和客户号两部分组成，共十二位数字，前四位为会员号，后八位为客户号。

3.3

客户内部资金账户 customer fund account

投资者用于期货资金清算的专用账户。

注：根据业务不同客户内部资金账户分为期货期权资金账户和证券现货资金账户。

3.4

保证金 margin

期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价值证券，用于结算和保证履约。

4 数据类别及类型

4.1 数据类别

本部分覆盖期货市场的期货及期权业务，暂未覆盖期货公司开展的资管业务。主要包括五大类业务数据：投资者账户数据、持仓业务数据、交割业务数据、结算业务资金数据、充抵业务数据，数据类别内容见表1。各数据类别涉及的数据项见附录A，数据项的代码取值见附录B。

表1 数据类别

序号	数据	说明	数据类别
1	投资者账户数据	该类数据旨在将各类投资者在期货市场开户时产生的客户资料进行整理，包括客户的基本信息以及投资者的各类账户信息及其对应关系。	投资者基本资料数据
			投资者编码数据
			投资者结算账户数据
2	持仓业务数据	该类数据旨在将投资者在期货市场的持仓数据进行整理。主要包含期货持仓、期权持仓及现货持仓。	投资者期货持仓数据
			投资者期权持仓数据
			投资者现货持仓数据
3	交割业务数据	该类数据旨在对期货合约进行交割行为所产生的相关数据进行整理，包括待交割和交割的数据信息。	待交割数据
			交割数据
4	结算业务资金数据	该类数据旨在对期货业投资者的每日结算数据进行整理。包括投资者的期货期权和现货账户资金数据结算信息及其他分项资金的结算信息。	投资者期货期权账户资金数据
			投资者现货账户资金数据
			投资者其他分项资金数据
5	充抵业务数据	该类数据旨在对投资者进行保证金充抵时产生的相关数据进行整理。	货币充抵明细数据
			非货币充抵明细数据

4.2 数据类型

数据类型说明：

——A，数字字符型。限于0—9，如交易所在地区代码，A4；

——C，字符型。如交易编码，C13；

——date，日期型。格式：YYYY-MM-DD；

——N，数值型。其长度不包含小数点，可参与数值计算。字段长度为x，表示该字段最长为x；字段长度为(x,y)，表示该字段最长为x，保留y位小数，如交易保证金，N(15,3)。

5 数据内容和格式

5.1 投资者账户数据

5.1.1 投资者基本资料数据

投资者基本资料数据内容和格式见表2，该数据内容属于期货市场投资者开户业务场景，内容为投资者开户过程中产生的关键信息。

表2 投资者基本资料数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHLXDM	客户类型代码	C	1	N	DIM01	
3	KHMC	客户名称	C	400	N		
4	SFZ	身份证号码	C	50	Y		境内自然人客户的身份证号码，如果是法人客户，此字段为空。
5	TZZXL	投资者学历	C	2	Y		根据 GB/T 4658—2006 确定的投资者学历代码。
6	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
7	JYBM	交易编码	C	13	N		投资者在期货交易所进行期货交易时使用的编码。
8	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
9	SZD	所在地	C	100	N		投资者的户籍地址。
10	TXDZ	通讯地址	C	200	N		
11	YZBM	邮政编码	C	6	N		
12	LXDH	联系电话	C	40	N		
13	JYSZDQDM	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
14	KHHXHBZ	开户和销户标志	C	1	N	DIM03	
15	KHRQ	客户期货期权内部资金账户开户日期	C	10	N		客户开户并生效的实际日期，并非预开户的日期。
16	ZZJGDM	组织机构代码	C	40	Y		境内法人客户的组织机构代码。如果是自然人客户，此字段为空。
17	YYZZH	营业执照号码	C	40	Y		境内法人客户的营业执照号码，如果是自然人客户，此字段为空。
18	TYSHXYDM	统一社会信用代码	C	18	Y		境内法人客户的统一社会信用代码，如果是自然人客户，此字段为空。
19	KHDLRMC	开户代理人名称	C	100	Y		
20	KHDLRSFZ	开户代理人身份证号码	C	50	Y		
21	ZHZTDM	账户状态代码	C	1	N	DIM04	
22	JWKHBZ	境外客户标志	C	1	Y	DIM05	
23	GJDQDM	国籍地区代码	C	10	Y		根据 GB/T 2659—2000 确定的国家地区代码；如果是境内客户，此字段为空。

表2 投资者基本资料数据的数据内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
24	JWGRKHZJHM	境外个人客户证件号码	C	50	Y		境外个人客户的护照号或港澳台个人客户往来大陆通行证号(注:目前港澳台个人客户的有效身份证明文件尚未最终确定,暂定为通行证);如果是境内客户、境外单位客户,此字段为空。
25	SYDJZJHM	商业登记证号码	C	50	Y		境外机构的商业登记证明文件号码,如果是境内客户、境外个人客户,此字段为空。
26	JWZJJGBZ	境外中介机构标志	C	1	Y	DIM16	
27	JWZJJGBH	境外中介机构编号	C	10	Y		如果不是境外中介机构,此字段为空。
28	XHNBZJZH	客户证券现货内部资金账户编码	C	18	Y		此字段填写证券现货资金账户,客户同时参与证券交易所股票期权交易的,期货公司需为客户单独开立证券现货内部资金账户,用于记录证券现货有关的资金和交易。如客户未参与证券业务(含备兑开仓、行权等与之相关的业务)的,此字段为空。
29	XHNBZJZHKHRQ	客户证券现货内部资金账户开户日期	date	10	Y		客户开户并生效的实际日期,(并非预开户的日期),格式:YYYY-MM-DD。如客户未开立证券现货内部资金账户,此字段为空。
30	JWTSCYZYJWZJJGBS	境外特殊参与者与境外中介机构标识	C	1	Y	DIM17	0:境外特殊经纪参与者;1:境外特殊非经纪参与者;2:境外中介机构;如果不是境外特殊参与者或境外中介机构,此字段为空。

5.1.2 投资者编码数据

投资者编码数据内容和格式见表3,该数据内容属于期货公司为参与期货期权交易和现货交易的投资者开立账户的业务场景,内容为期货期权资金账户与衍生品合约账号对应关系、现货资金账户与证券账户的对应关系。

表3 投资者编码数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为:YYYY-MM-DD

表3 投资者编码数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
2	KHNBZJZHB	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的期货期权资金账户或证券现货资金账户，期货期权业务：填写期货期权资金账户；证券现货业务：填写证券现货资金账户。
3	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
4	JYBM	交易编码	C	13	N		填写期货期权资金账户的交易编码或证券现货资金账户的交易编码。其中期货期权资金账户的交易编码，填写证券交易所的衍生品合约账户（即客户证券账户+888）；证券现货资金账户的交易编码，填写客户在证券交易所的证券账户。

5.1.3 投资者结算账户数据

投资者结算账户数据内容和格式见表4，该数据内容为期货市场投资者开户设立结算账户时产生的数据信息。

表4 投资者结算账户数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHB	客户内部资金账户编码	C	18	N		期货期权业务：填写期货期权资金账户；证券现货业务：填写证券现货资金账户，将交易会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构视为客户处理。
3	YHBM	银行编码	C	2	N	DIM15	
4	YHZH	银行账户编码	C	22	N		
5	JSZHBGBZ	结算账户变更标志	C	1	N	DIM12	
6	YHZHKHRXM	银行账户开户人姓名	C	400	Y		该银行账户的开户人名称。
7	KHH	银行账户的开户行名称	C	400	Y		开户银行具体网点（到支行）。
8	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.2 持仓业务数据

5.2.1 投资者期货持仓数据

期货持仓数据内容和格式见表5，该数据内容为期货市场各类投资者交易、强平、期转现、期权行权等行为产生的期货持仓结果。

表5 期货持仓数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	PZHY	品种合约代码	C	30	N		
4	MMFXDM	买卖方向代码	C	1	N	DIM06	
5	TJTBBZ	投机套保标志	C	1	N	DIM07	
6	CCSL	持仓数量	N	10	N		单位：手
7	KCJ	开仓价	N	(20, 3)	N		
8	JYBZJ	交易保证金	N	(20, 3)	N		
9	ZRCCYK	持仓盈亏（逐日盯市）	N	(20, 3)	N		
10	ZBCCYK	持仓盈亏（逐笔对冲）	N	(20, 3)	N		
11	CCJJ	持仓均价	N	(20, 3)	N		
12	ZJSJ	昨结算价	N	(20, 3)	N		
13	JJSJ	今结算价	N	(20, 3)	N		
14	JYBM	交易编码	C	13	N		该笔持仓对应交易所的客户交易编码。
15	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
16	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.2.2 投资者期权持仓数据

期权持仓数据内容和格式见表6，该数据内容为期货市场各类投资者交易、强平、期转现、期权行权等行为产生的期权持仓结果。

表6 期权持仓数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	PZHY	品种合约代码	C	30	N		商品期权合约代码，如：“M1311-C-2900”；股票期权合约代码，如“510050C1403M01600”。

表6 期权持仓数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
4	JYBM	交易编码	C	13	N		商品期权：该笔持仓对应期货交易所的客户交易编码；股票期权：该笔持仓对应证券交易所的衍生品合约账号（即客户证券账户+888）。
5	MMFXDM	买卖方向代码	C	1	N	DIM06	
6	TJTBBZ	投机套保标志	C	1	Y	DIM07	股票期权业务下，此字段为空。
7	CCSL	持仓数量	N	10	N		商品期权以“手”为单位；股票期权以“张”为单位。
8	JYBZJ	交易保证金	N	(20, 3)	N		商品期权：期权卖方交易保证金额；股票期权：期权卖方应交维持保证金金额。
9	ZRCCYK	持仓盈亏(逐日盯市)	N	(20, 3)	N		
10	ZBCCYK	持仓盈亏(逐笔对冲)	N	(20, 3)	N		
11	CCJJ	持仓均价	N	(20, 3)	N		
12	ZJSJ	昨结算价	N	(20, 3)	N		
13	JJSJ	今结算价	N	(20, 3)	N		
14	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
15	BZDM	币种代码	C	3	N		根据GB/T 12406—2008确定的币种代码，例如：USD；CNY。
16	QQLXDM	期权类型代码	C	1	N	DIM08	
17	ZXJ	执行价	N	(20, 7)	N		
18	BDPZ	标的品种	C	2	N		商品期权：大写英文字母表示；股票期权：标的证券代码。
19	BDHY	标的合约	C	30	N		
20	BDBZ	备兑标志	C	1	N	DIM14	投资者进行期权交易时是否是备兑开仓。

5.2.3 投资者现货持仓数据

现货持仓数据内容和格式见表7，该数据内容为期货市场各类投资者备兑开仓以及行权相关的证券现货业务产生的持仓结果。

表7 现货持仓数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD

表7 现货持仓数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
2	XHNBZJZH	客户证券现货内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行现货交易的资金账户。
3	ZQZHBH	客户证券账户编码	C	13	N		
4	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
5	ZJDM	证券代码	C	6	N		
6	ZJZWMC	证券的中文简称	C	30	N		
7	ZQLBDM	证券类别代码	C	2	N	DIM09	
8	LTLDXDM	流通类型代码	C	1	N	DIM10	
9	QYLDXDM	权益类别代码	C	2	N	DIM11	
10	GPNF	挂牌年份	C	4	N		
11	DRCCL	当日持仓量	N	16	N		全部持有证券的数量，单位：股。
12	CCKYL	持仓可用量	N	16	N		当日持仓量中，未被冻结的证券的数量。
13	CCCBJ	持仓成本价	N	(20, 3)	N		证券现货持仓成本
14	CCZXJ	持仓最新价	N	(20, 3)	N		
15	CCFDYK	持仓浮动盈亏	N	(20, 3)	N		
16	SZ	市值	N	(20, 3)	N		所持股票按最新价计算的市值。

5.3 交割业务数据

5.3.1 待交割数据

待交割数据内容和格式见表8，该数据内容为进入交割月后，有交割意向的期货市场机构投资者准备交割的持仓数据信息。

表8 待交割数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBH	客户内部资金账户编码	C	18	Y		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	JYBM	交易编码	C	13	N		该笔待交割持仓对应交易所的客户交易编码。
4	PZHY	品种合约代码	C	30	N		
5	MMFXDM	买卖方向代码	C	1	N	DIM06	
6	DJYCCL	待交割持仓量	N	10	N		进入交割月，准备进行交割的持仓量，单位：手。
7	JGBZJ	交割保证金	N	(20, 3)	N		单位：元

表 8 待交割数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
8	KCJ	开仓价	N	(20, 3)	Y		
9	JGJSJ	交割结算价	N	(20, 3)	N		
10	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	
11	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.3.2 交割数据

交割数据内容和格式见表 9，该数据内容为期货市场机构投资者的交割行为产生的数据信息。

表 9 交割数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	Y		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	JYBM	交易编码	C	13	N		该笔交割对应交易所的客户交易编码。
4	PZHY	品种合约代码	C	30	N		交割合约号
5	MMFXDM	买卖方向代码	C	1	N	DIM06	
6	CJJJ	成交均价	N	(20, 3)	N		分客户分品种合约分买卖的开仓成交均价。
7	CJJE	成交金额	N	(20, 3)	N		总额
8	JGJSJ	交割结算价	N	(20, 3)	N		
9	JGHK	交割货款	N	(20, 3)	N		
10	JGSS	交割手数	N	10	N		
11	JGSXF	交割手续费	N	(20, 3)	N		
12	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.4 结算业务资金数据

5.4.1 投资者期货期权账户资金数据

期货期权账户资金数据内容和格式见表10，该数据内容用于描述期货市场投资者的期货期权资金信息。

表 10 期货期权账户资金数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	ZJQYZE	资金权益总额	N	(20, 3)	N		当日客户（或交易会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构）权益。
4	KYZJ	可用资金	N	(20, 3)	N		逐日盯市下计算得出的可用资金，此外，在逐笔对冲下，将浮动盈亏算入可用资金后，其额度应该等同于在逐日盯市下计算得出的可用资金。
5	ZJBZJ	追加保证金	N	(20, 3)	Y		
6	FXD	风险度	N	(20, 3)	Y		去掉百分号，如 46 表示 46%。
7	ZRSRJJC	上日结存（逐日盯市）	N	(20, 3)	N		
8	ZBSRJJC	上日结存（逐笔对冲）	N	(20, 3)	Y		
9	ZRDRJC	当日结存（逐日盯市）	N	(20, 3)	N		
10	ZBDRJC	当日结存（逐笔对冲）	N	(20, 3)	Y		
11	ZRDRZYK	当日总盈亏（逐日盯市）	N	(20, 3)	N		逐日盯市下的当日总盈亏
12	ZBDRZYK	当日总盈亏（逐笔对冲）	N	(20, 3)	Y		逐笔对冲下的平仓盈亏
13	ZBFDYK	浮动盈亏（逐笔对冲）	N	(20, 3)	Y		逐笔对冲方式计算的浮动盈亏
14	FHBCDJE	非货币充抵金额	N	(20, 3)	N		仓单等有价值证券充抵额度，不含其它货币充抵金额部分。
15	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。
16	SYRMBZJ	实有人民币资金	N	(20, 3)	N		人民币实有货币资金余额，不含非货币充抵金额和货币充抵金额。
17	HBCDJE	货币充抵金额	N	(20, 3)	N		当日其他货币余额的充抵金额，以美元充抵人民币为例，此项为当日美元余额充抵为人民币的金额。无币种间充抵业务的客户该字段值为零。

表 10 期货期权账户资金数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
18	QTHBZCJE	其它货币质出金额	N	(20, 3)	Y		原油期货暂无此业务，此字段值为零。
19	HBZYBZJZY	货币质押保证金占用	N	(20, 3)	Y		原油期货暂无此业务，此字段值为零。
20	DRZQLJ	当日总权利金	N	(20, 3)	Y		期权业务(含股票期权业务)的当日权利金收支余额，无期权业务的该字段为零。
21	DJZJ	冻结资金	N	(20, 3)	Y		针对股票期权业务增加此字段，即有冻结资金款项产生时，填写此字段。

5.4.2 投资者现货账户资金数据

现货账户资金数据内容和格式见表 11，该接口数据用于描述期货市场投资者的现货资金信息。

表 11 投资者现货账户资金数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	XHNBZJZH	客户证券现货内部资金账户编码	C	18	N		期货公司开展与股票期权备兑开仓以及行权相关证券经纪业务时，为客户单独开立的证券现货资金账户。
3	DRZJYE	当日资金账户余额	N	(20, 3)	N		证券现货账户内，未被占用的可用资金总额以及冻结资金等全部资金金额合计。
4	DRKYZJ	当日可用资金	N	(20, 3)	N		证券现货账户内当日可用资金余额，可用资金余额为负，表示客户资金不足。
5	BQJEHJ	买券金额合计	N	(20, 3)	N		当日客户证券账户内，用于买券的资金合计，以正数表示。
6	SQJEHJ	卖券金额合计	N	(20, 3)	N		当日客户证券现货账户内，卖券所得资金合计，以正数表示。
7	CJHJ	出金合计	N	(20, 3)	N		当日客户证券现货账户内的出金合计，以负数表示。
8	RJHJ	入金合计	N	(20, 3)	N		当日客户证券现货账户内的入金合计，以正数表示。
9	SRZJJE	上日资金账户余额	N	(20, 3)	N		客户证券现货账户内上日资金余额。

表 11 投资者现货账户资金数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
10	GPSZ	股票市值	N	(20, 3)	N		客户所持股票现货的市值。
11	ZZC	总资产	N	(20, 3)	N		总资产=股票市值+当日资金账户余额
12	YHS	印花税	N	(20, 3)	N		
13	JSF	经手费	N	(20, 3)	N		
14	GHF	过户费	N	(20, 3)	N		
15	ZGF	证管费	N	(20, 3)	N		
16	SXF	手续费	N	(20, 3)	N		
17	QTFY	其他费用	N	(20, 3)	N		
18	LX	利息	N	(20, 3)	N		
19	SJSF	实际收付	N	(20, 3)	N		实际收付为正数时以正数表示，实际支付为负数时，以负数表示。
20	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.4.3 投资者其他分项资金数据

其他分项资金数据内容和格式见表 12，该数据内容适用于描述期货市场投资者的其他资金信息。

表 12 投资者其他分项资金数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	JYCSDM	交易场所代码	C	2	N	DIM02	如果资金项目为交易手续费 A001，结算手续费 A017 时，资金金额取客户在所有交易所的资金合计数，该交易所标识字段可以为空。其余资金项目必须分交易所填写，不能为空，S：上期所；Z：郑商所；D：大商所；J：中金所；N：上海能源交易中心；H：上海证券交易所；P：深圳证券交易所。
4	ZJXMBH	资金项目编号	C	4	N	DIM13	用于说明期货公司调整资金项目的理由。
5	ZJJE	资金金额	N	(20, 3)	N		+表示客户收入，-表示支出。

表 12 投资者其他分项资金数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
6	MEMO	备注	C	100	Y		用于说明期货公司调整资金项目的理由。
7	JYBM	交易编码	C	13	N		该笔分项资金对应期货交易所的客户交易编码和证券交易所的客户证券账户及衍生品合约账户。
8	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

5.5 充抵业务数据

5.5.1 货币充抵明细数据

货币充抵明细数据内容和格式见表 13，该数据内容用于描述期货市场投资者进行货币充抵行为产生的数据信息。

表 13 货币充抵明细数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	YBZDM	原币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。
4	YBZYE	原币种余额	N	(20, 3)	N		
5	CDMBBZDM	充抵目标币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。
6	CDJE	充抵金额	N	(20, 3)	N		
7	CDHL	充抵汇率	N	(16, 8)	N		
8	CDZKL	充抵折扣率	N	(16, 8)	N		
9	MEMO	备注	C	100	Y		

5.5.2 非货币充抵明细数据

非货币充抵明细数据内容和格式见表 14，该数据内容用于描述期货市场投资者进行非货币充抵行为产生的数据信息。

表 14 非货币充抵明细数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	RQ	日期	date	10	N		格式为：YYYY-MM-DD
2	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	N		投资者在期货公司开立的进行期货期权交易的资金账户。
3	CDPMC	充抵品名称	C	6	N		
4	CDSS	充抵手数	N	10	N		
5	CDJG	充抵价格	N	(20, 3)	N		仓单填各品种对应标准单位的折后价格。
6	CDJE	充抵金额	N	(20, 3)	N		充入为正，充出为负。
7	BZDM	币种代码	C	3	N		根据 GB/T 12406—2008 确定的币种代码，例如：USD；CNY。

附 录 A
(规范性附录)
数据字典

数据字典内容见表A.1。

表 A.1 数据字典

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
1	RQ	日期	date	10	
2	KHLXDM	客户类型代码	C	1	DIM01
3	KHMC	客户名称	C	400	
4	SFZ	身份证号码	C	50	
5	TZZXL	投资者学历	C	2	
6	JYCSDM	交易场所代码	C	2	DIM02
7	JYBM	交易编码	C	13	
8	KHNBZJZHBM	客户内部资金账户编码	C	18	
9	SZD	所在地	C	100	
10	TXDZ	通讯地址	C	200	
11	YZBM	邮政编码	C	6	
12	LXDH	联系电话	C	40	
13	JYSZDQDM	交易所在地区代码	A	4	
14	KHHXHBZ	开户和销户标志	C	1	DIM03
15	KHRQ	客户期货期权内部资金账户开户日期	C	10	
16	ZZJGDM	组织机构代码	C	40	
17	YYZZH	营业执照号码	C	40	
18	TYSHXYDM	统一社会信用代码	C	18	
19	KHDLRMC	开户代理人名称	C	100	
20	KHDLRSFZ	开户代理人身份证号码	C	50	
21	ZHZTDM	账户状态代码	C	1	DIM04
22	JWKHBZ	境外客户标志	C	1	DIM05
23	GJDQDM	国籍地区代码	C	10	
24	JWGRKHZJHM	境外个人客户证件号码	C	50	
25	SYDJZHM	商业登记证号码	C	50	
26	JWZJJGBZ	境外中介机构标志	C	1	DIM16
27	JWZJJGBH	境外中介机构编号	C	10	
28	XHNBZJZH	客户证券现货内部资金账户编码	C	18	
29	XHNBZJZHKHRQ	客户证券现货内部资金账户开户日期	date	10	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
30	YHBM	银行编码	C	2	DIM15
31	YHZH	银行账户编码	C	22	
32	JSZHBGBZ	结算账户变更标志	C	1	DIM12
33	YHZHKHRXM	银行账户开户人姓名	C	400	
34	KHH	银行账户的开户行名称	C	400	
35	BZDM	币种代码	C	3	
36	PZHY	品种合约代码	C	30	
37	MMFXDM	买卖方向代码	C	1	DIM06
38	TJTBBZ	投机套保标志	C	1	DIM07
39	CCSL	持仓数量	N	10	
40	ZRCCYK	持仓盈亏(逐日盯市)	N	(20, 3)	
41	ZBCCYK	持仓盈亏(逐笔对冲)	N	(20, 3)	
42	CCJJ	持仓均价	N	(20, 3)	
43	ZJSJ	昨结算价	N	(20, 3)	
44	JJSJ	今结算价	N	(20, 3)	
45	QQLXDM	期权类型代码	C	1	DIM08
46	ZXJ	执行价	N	(20, 7)	
47	BDPZ	标的品种	C	2	
48	BDHY	标的合约	C	30	
49	BDBZ	备兑标志	C	1	DIM14
50	ZQZHBM	客户证券账户编码	C	13	
51	ZJDM	证券代码	C	6	
52	ZJZWMC	证券的中文简称	C	30	
53	ZQLBDM	证券类别代码	C	2	DIM09
54	LTLXDM	流通类型代码	C	1	DIM10
55	QYLXDM	权益类别代码	C	2	DIM11
56	GPNF	挂牌年份	C	4	
57	DRCCCL	当日持仓量	N	16	
58	CCKYL	持仓可用量	N	16	
59	CCCBJ	持仓成本价	N	(20, 3)	
60	CCZXJ	持仓最新价	N	(20, 3)	
61	CCFDYK	持仓浮动盈亏	N	(20, 3)	
62	SZ	市值	N	(20, 3)	
63	DJYCCL	待交割持仓量	N	10	
64	KCJ	开仓价	N	(20, 3)	
65	JGJSJ	交割结算价	N	(20, 3)	
66	CJJJ	成交均价	N	(20, 3)	
67	CJJE	成交金额	N	(20, 3)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
68	JGSS	交割手数	N	10	
69	JGSXF	交割手续费	N	(20, 3)	
70	ZJQYZE	资金权益总额	N	(20, 3)	
71	KYZJ	可用资金	N	(20, 3)	
72	ZJBZJ	追加保证金	N	(20, 3)	
73	FXD	风险度	N	(20, 3)	
74	ZRSRJC	上日结存（逐日盯市）	N	(20, 3)	
75	ZBSRJC	上日结存（逐笔对冲）	N	(20, 3)	
76	ZRDRJC	当日结存（逐日盯市）	N	(20, 3)	
77	ZBDRJC	当日结存（逐笔对冲）	N	(20, 3)	
78	ZRDRZYK	当日总盈亏（逐日盯市）	N	(20, 3)	
79	ZBDRZYK	当日总盈亏（逐笔对冲）	N	(20, 3)	
80	ZBFDYK	浮动盈亏（逐笔对冲）	N	(20, 3)	
81	SYRMBZJ	实有人民币资金	N	(20, 3)	
82	HBCDJE	货币充抵金额	N	(20, 3)	
83	QTHBZCJE	其它货币质出金额	N	(20, 3)	
84	HBZYBZJZY	货币质押保证金占用	N	(20, 3)	
85	DRZQLJ	当日总权利金	N	(20, 3)	
86	DJZJ	冻结资金	N	(20, 3)	
87	JYBZJ	交易保证金	N	(20, 3)	
88	JGBZJ	交割保证金	N	(20, 3)	
89	FHBCDJE	非货币充抵金额	N	(20, 3)	
90	JGHK	交割货款	N	(20, 3)	
91	DRZJYE	当日资金账户余额	N	(20, 3)	
92	DRKYZJ	当日可用资金	N	(20, 3)	
93	BQJEHJ	买券金额合计	N	(20, 3)	
94	SQJEHJ	卖券金额合计	N	(20, 3)	
95	CJHJ	出金合计	N	(20, 3)	
96	RJHJ	入金合计	N	(20, 3)	
97	SRZJJE	上日资金账户余额	N	(20, 3)	
98	GPSZ	股票市值	N	(20, 3)	
99	ZZC	总资产	N	(20, 3)	
100	YHS	印花税	N	(20, 3)	
101	JSF	经手费	N	(20, 3)	
102	GHF	过户费	N	(20, 3)	
103	ZGF	证管费	N	(20, 3)	
104	SXF	手续费	N	(20, 3)	
105	QTFY	其他费用	N	(20, 3)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值
106	LX	利息	N	(20, 3)	
107	SJSF	实际收付	N	(20, 3)	
108	ZJXMBH	资金项目编号	C	4	DIM13
109	ZJJE	资金金额	N	(20, 3)	
110	MEMO	备注	C	100	
111	YBZDM	原币种代码	C	3	
112	YBZYE	原币种余额	N	(20, 3)	
113	CDMBBZDM	充抵目标币种代码	C	3	
114	CDJE	充抵金额	N	(20, 3)	
115	CDHL	充抵汇率	N	(16, 8)	
116	CDZKL	充抵折扣率	N	(16, 8)	
117	CDPMC	充抵品名称	C	6	
118	CDSS	充抵手数	N	10	
119	CDJG	充抵价格	N	(20, 3)	
120	JWTSCYZYJWZJ JGBS	境外特殊参与者与境外中介机构标识	C	1	DIM17

附 录 B
(规范性附录)
代码取值及描述

B.1 客户类型代码

客户类型代码取值内容见表B.1。

表 B.1 客户类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
客户类型代码/DIM01	0	自然人
	1	一般法人
	2	特殊法人
	3	单一客户纯期货资产管理计划
	4	单一客户综合类资产管理计划
	5	特定多个客户纯期货资产管理计划
	6	特定多个客户综合类资产管理计划
	9	其它

B.2 交易场所代码

交易场所代码取值内容见表B.2。

表 B.2 交易场所代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
交易场所代码/DIM02	S	上期所
	Z	郑商所
	D	大商所
	J	中金所
	N	上海能源交易中心
	H	上海证券交易所
	P	深圳证券交易所

B.3 开户和销户标志

开户和销户标志代码取值内容见表B.3。

表 B.3 开户和销户标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
开户和销户标志/DIM03	a	已开户的客户
	d	当日销户的客户

B.4 账户状态代码

账户状态代码取值内容见表B.4。

表 B.4 账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
账户状态代码/DIM04	a	活跃账户
	d	休眠账户

B.5 境外客户标志

境外客户标志代码取值内容见表B.5。

表 B.5 境外客户标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
境外客户标志/DIM05	1	国内客户
	2	港澳台客户
	3	国外客户
	4	在中国永久居留客户

B.6 买卖方向代码

买卖方向代码取值内容见表B.6。

表 B.6 买卖方向代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
买卖方向代码/DIM06	B	买
	S	卖

B.7 投机套保标志

投机套保标志代码取值内容见表B.7。

表 B.7 投机套保标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
投机套保标志/DIM07	S	投机

表 B.7 投机套保标志代码取值（续）

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
投机套保标志/DIM07	H	套保
	A	套利

B.8 期权类型代码

期权类型代码取值内容见表B.8。

表 B.8 期权类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
期权类型代码/DIM08	C	看涨期权
	P	看跌期权

B.9 证券类别代码

证券类别代码取值内容见表B.9。

表 B.9 证券类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证券类别代码/DIM09	01	普通股票
	02	配股
	03	配售股
	04	标准(普通)投资基金/共同基金
	05	交易型开放式指数基金(ETF)
	06	普通债券
	07	股票质押式回购
	08	债券质押式回购/协议回购
	09	约定购回
	10	融资融券
	11	期货
	12	期权
	13	权证
	14	资产支持债券
	15	其他

B.10 流通类型代码

流通类型代码取值内容见表B.10。

表 B.10 流通类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
流通类型代码/DIM10	0	无限售条件流通股
	N	非流通

B.11 权益类别代码

权益类别代码取值内容见表B.11。

表 B.11 权益类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
权益类别代码/DIM11	DF	兑付
	DX	兑息
	HL	红利
	PG	配股
	SG	送股
	ZP	转配

B.12 结算账户变更标志

结算账户变更标志代码取值内容见表B.12。

表 B.12 结算账户变更标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
结算账户变更标志/DIM12	a	现有
	d	废除

B.13 资金项目编号

资金项目编号代码取值内容见表B.13。

表 B.13 资金项目编号代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
资金项目编号/DIM13	A000	客户总盈亏(持仓盈亏+平仓盈亏+交割配对盈亏+行权盈亏)
	A001	交易手续费(含股票期权业务的“清算经手费”和“权利金结算费”)
资金项目编号/DIM13	A002	交割货款(含股票期权业务的“清算行权交收资金”)
	A003	交割手续费(含股票期权业务的“清算行权过户费”)

表 B.13 资金项目编号代码取值(续)

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
资金项目编号/DIM13	A004	非货币充抵变动额(今日非货币充抵余额-上日非货币充抵余额) 证券充抵保证金业务开展后,证券充抵保证金的变动额也利用此字段填报。
	A005	非货币充抵手续费
	A006	期转现手续费
	A007	仓储费/仓租费
	A008	交割配对盈亏(逐日盯市)
	A009	仓单升贴水
	A010	仓单转让手续费
	A011	交割定金/定金
	A012	定金罚没
	A013	交割违约罚款
	A014	仓单抵押手续费
	A015	强平盈利罚没
	A016	冻结款
	A017	结算手续费
	A018	仓单转让货款
	A019	卖方交割保证金
	A020	买方交割补偿金
	A021	卖方交割补偿金
	A022	过户费(国债)
	A023	转托管费
	A024	行权手续费(含股票期权业务的“清算行权结算费”)
	A026	货币充抵变动额(今日货币充抵余额-上日货币充抵余额)
	A027	资产管理业绩报酬或管理费
	A030	中金所申报费
	A031	手续费返还
	A032	利息
	A999	其他与客户有关资金

B.14 备兑标志

备兑标志代码取值内容见表B.14。

表 B.14 备兑标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
备兑标志/DIM14	1	备兑
	2	非备兑

B.15 银行编码

银行编码代码取值内容见表B.15。

表 B.15 银行编码代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
银行编码/DIM15	01	工商银行
	02	农业银行
	03	中国银行
	04	建设银行
	05	交通银行
	06	浦发银行
	07	兴业银行
	08	汇丰银行
	09	光大银行
	10	招商银行
	11	中信银行
	12	民生银行
	13	广发银行
	14	花旗银行
	15	平安银行
	16	邮储银行
	17	渣打银行
	18	农业发展银行
	99	其他银行

B.16 境外中介机构标志

境外中介机构标志代码取值内容见表B.16。

表 B.16 境外中介机构标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
境外中介机构标志/DIM16	0	境外中介机构
	1	非境外中介机构

B. 17 境外特殊参与者与境外中介机构

境外特殊参与者与境外中介机构标识表B. 17。

表 B. 17 境外特殊参与者与境外中介机构标识

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
境外特殊参与者与境外中介机构标识 /DIM17	0	境外特殊经纪参与者
	1	境外特殊非经纪参与者
	2	境外中介机构

参 考 文 献

- [1] 上海期货交易所. 上海期货交易所交易细则[Z]. 2016-12-12
 - [2] 中华人民共和国国务院. 期货交易管理条例[Z]. 2012-10-24
-



中 华 人 民 共 和 国 金 融 行 业 标 准

JR/T 0177.3—2020

证券期货业投资者权益相关数据的内容和 格式 第3部分：基金

Contents and formats of data on investors' rights and interests in the securities and
futures industry—Part3: Fund

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发 布

目 次

前言..... II

1 范围..... 1

2 规范性引用文件..... 1

3 术语和定义..... 1

4 数据类别及类型..... 1

 4.1 数据类别..... 1

 4.2 数据类型..... 2

5 数据内容和格式..... 2

 5.1 投资者账户数据..... 2

 5.2 基金动态数据..... 4

 5.2.1 基金行情数据..... 4

 5.2.2 份额对账数据..... 4

 5.3 基金分红数据..... 5

 5.4 投资者权益相关的交易类确认数据..... 7

 5.4.1 业务明细..... 7

 5.4.2 数据内容..... 20

附录 A （规范性附录） 数据字典.....23

附录 B （规范性附录） 代码取值及描述.....27

参考文献..... 51

前 言

JR/T 0177—2020《证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式》分为3部分内容：

——第1部分：证券；

——第2部分：期货；

——第3部分：基金。

本部分为JR/T 0177—2020的第3部分。

本部分依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本部分由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本部分由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本部分起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、中证信息技术服务有限责任公司、恒生电子股份有限公司。

本部分主要起草人：姚前、刘铁斌、罗凯、王东明、周云晖、路一、周桢、罗璇、贾石、韩晓红、程英杭、李圣书。

证券期货业投资者权益相关数据的内容和格式 第3部分：基金

1 范围

本部分规定了基金业投资者权益数据的数据类别及类型、数据内容和格式等内容，数据内容和格式包括投资者账户数据、基金动态数据、基金分红数据、投资者权益相关的交易类确认数据等。

本部分适用于行业机构开展基金业投资者权益数据治理相关工作。

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，仅所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/T 4658—2006 学历代码

GB/T 1349—1992 全国清算中心代码

GB/T 12406—2008 表示货币和资金的代码

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

基金投资者 fund investor

公开募集基金的基金份额持有人。

3.2

基金账户 transfer agent account

注册登记人为基金投资者设立的，用于记录和保存持有人基金单位份数的账户。

3.3

基金交易账户 fund trading account

基金销售机构为投资者开立的，记录投资者通过该销售机构买卖基金份额、基金份额变动及资金结余情况的账户。

4 数据类别及类型

4.1 数据类别

本部分覆盖基金市场公募基金产品，暂未覆盖基金专户、私募基金等非公募产品。主要包括四大类业务数据：投资者账户数据、基金动态数据、基金分红数据、投资者权益相关的交易类确认数据，数据类别内容见表1。各数据类别涉及的数据项见附录A，数据项的代码取值见附录B。

表 1 数据类别

序号	数据	说明	数据类别
1	投资者账户数据	对基金行业和投资者相关的账户类业务进行梳理，包括开户、销户、账户资料修改、增加交易账号、变更交易账号、基金账户冻结、基金账户解冻等相关业务。	投资者账户数据
2	基金动态数据	每日基金动态信息数据。	基金行情数据 份额对账数据
3	基金分红数据	基金管理人根据投资者份额对账数据信息分配分红金额，对投资者发放红利/红利再投资的数据。	基金分红数据
4	投资者权益相关的交易类确认数据	对基金行业和投资者相关的交易类业务进行梳理，包括认购、基金成立、申购、赎回、基金转换、募集失败等相关业务。	投资者权益相关的交易类确认数据

4.2 数据类型

数据类型说明：

——C，字符型。如销售机构编码，C9；

——A，数字字符型。限于 0—9，如投资者基金账户编码，A12；

——N，数值型。其长度不包含小数点，可参与数值计算。字段长度为 x，表示该字段最长为 x；字段长度为 (x, y)，表示该字段最长为 x，保留 y 位小数，如每笔交易确认金额，N(16, 2)。

5 数据内容和格式

5.1 投资者账户数据

投资者账户数据内容和格式见表 2。

表 2 投资者账户数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		
5	Address	通讯地址	C	60	Y		
6	InstReprIDCode	法定代表人身份证号码	C	18	Y		
7	InstReprIDType	法定代表人证件类型代码	C	1	Y	DIM01	
8	InstReprName	法定代表人姓名	C	20	Y		
9	CertificateNo	投资者证件号码	C	30	N		
10	InvestorName	投资者账户名称	C	60	N		

表2 投资者账户数据的数据内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
11	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	N	DIM02	
12	EducationLevel	投资者学历	C	2	Y		根据 GB/T 4658-2006 确定的投资者学历代码。
13	PostCode	投资者邮政编码	A	6	Y		
14	TransactorCertNo	经办人证件号码	C	18	Y		
15	TransactorCertType	经办人证件类型代码	C	1	Y	DIM01	
16	TransactorName	经办人姓名	C	20	Y		
17	InvestorsBirthDay	投资者出生日期	A	8	Y		
18	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
19	EmailAddress	投资者电子邮箱	C	40	Y		
20	FaxNo	投资者传真号码	C	24	Y		
21	HomeTelNo	投资者住址电话	C	22	Y		
22	MobileTelNo	投资者移动电话	C	24	Y		
23	AccountAbbr	投资者户名称	C	12	Y		
24	ConfidentialDocumentCode	密函编号	C	8	Y		
25	Sex	投资者性别代码	A	1	Y	DIM03	
26	SHSecuritiesAccountID	上海证券账户编码	C	10	Y		
27	SZSecuritiesAccountID	深圳证券账户编码	C	10	Y		
28	TelNo	投资者电话号码	C	22	Y		
29	TradingMethod	渠道类别代码	C	8	Y		共 8 个字符, 每个字符代表一种交易手段, 其含义为: 第 1 位: CALLCENTER, 第 2 位: INTERNET, 第 3 位: 自助终端, 第 4 位: 柜台, 第 5~8 位: 保留; 每个字符取 1 表示使用此种手段, 取 0 表示不使用。
30	MinorFlag	未成年人标志	C	1	Y		0-否, 1-是。
31	TransactorIDType	经办人识别方式代码	C	1	Y	DIM04	
32	MultiAcctFlag	多渠道开户标志	A	1	Y	DIM05	
33	DeliverWay	对账单寄送方式代码	C	8	Y		共 8 个字符, 每个字符代表一种交易手段, 其含义为: 第 1 位: 邮寄, 第 2 位: 传真, 第 3 位: E-mail, 第 4 位: 短消息, 第 5~8 位: 保留; 每位字符取 1 表示采用此种手段, 取 0 表示不使用。
34	NetNo	操作(清算)网点编码	C	9	Y		
35	FrozenCause	冻结原因代码	A	1	Y	DIM06	

表2 投资者账户数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
36	FreezingDeadline	冻结截止日期	A	8	Y		
37	AccountStatus	基金账户状态代码	C	1	N	DIM07	
38	TransactionAccountStatus	交易账户状态代码	C	1	N	DIM08	

5.2 基金动态数据

5.2.1 基金行情数据

基金行情数据的内容和格式见表3。

表3 基金行情数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	FundCode	基金代码	C	6	N		
2	FundName	基金名称	C	40	N		
3	UpdateDate	基金净值日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
4	TotalFundVol	基金总份数	N	(16, 2)	N		该基金代码当日总份数。
5	FundStatus	基金状态代码	C	1	N	DIM09	
6	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	N		
7	AccumulativeNAV	累计基金单位净值	N	(7, 4)	N		
8	FundSize	基金规模	N	(16, 2)	N		基金的金额规模
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码, 例如: 156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克等。
10	RegistrarCode	基金份额登记机构编码	A	2	Y		
11	TotalDivident	累计单位分红	N	(8, 5)	Y		
12	DefDividendMethod	默认分红方式代码	A	1	N	DIM10	
13	FundType	基金类型代码	C	2	Y	DIM12	

5.2.2 份额对账数据

份额对账数据内容和格式见表4, 该数据内容为投资者份额对账数据信息。

表4 份额对账数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AvailableVol	持有人可用基金份额	N	(16, 2)	N		
8	TotalVolOfDistributorInTA	基金总份数	N	(16, 2)	N		含冻结份数
9	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
10	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N	(16, 2)	Y		仅包括账户类和交易类冻结业务及派生继续冻结的份额。
11	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	Y		明细标志为1时，为必填。
12	DetailFlag	数据明细标志	A	1	N	DIM14	汇总是指对基金账户的对账，明细是指对基金账户具体过户日或TA 确认交易流水号的对账。
13	ShareRegisterDate	份额注册日期	A	8	Y		明细标志为1时，为必填。
14	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未付收益金额	N	(16, 2)	Y		货币基金时，为必填。
15	UndistributeMonetaryIncomeFlag	货币基金未付收益金额正负标志	C	1	Y	DIM11	货币基金时，为必填。
16	GuaranteedAmount	剩余保本金额	N	(16, 2)	Y		保本基金时，为必填。
17	SourceType	份额原始来源代码	C	1	Y	DIM15	明细标志为1时，为必填。
18	DefDividendMethod	默认分红方式代码	A	1	Y	DIM10	

5.3 基金分红数据

基金分红数据内容和格式见表5，该数据内容为投资者分红数据信息。

表5 基金分红数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式,则用销售商代码作为网点号码;否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	BasisforCalculatingDividend	基金分红基数	N	(16, 2)	N		登记日基金持有人的基金份额。
8	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406 — 2008 中的 3 位数字代码,例如: 156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克等。
10	VolOfDividendforReinvestment	基金账户红利再投资基金份数	N	(16, 2)	N		投资者实得红股, 含被续冻的红股。
11	DividentDate	权益发放日期	A	8	N		
12	DividendAmount	基金账户红利资金	N	(16, 2)	N		红利总金额, 含冻结红利及再投资的红利。
13	XRDate	除权日	A	8	N		
14	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		实发红利资金, 不含冻结红利及再投资的红利。
15	RegistrationDate	权益登记日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
16	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
17	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
18	DividendPerUnit	单位基金分红金额	N	(16, 2)	N		分红金额中含税, 每千份分两元, 则此处填 2。
19	DefDividendMethod	默认分红方式代码	A	1	N	DIM10	
20	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992 确定的交易所在地区代码。
21	Charge	手续费	N	(10, 2)	N		
22	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	N		

表5 基金分红数据的数据内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
23	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	Y		分红再投资基金净值
24	OtherFee1	其他费用 1	N	(10, 2)	Y		
25	OtherFee2	其他费用 2	N	(16, 2)	Y		
26	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
27	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		TA 对每笔确认的唯一标识。
28	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	Y		
29	FrozenBalance	冻结金额	N	(16, 2)	Y		
30	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
31	FrozenSharesforReinvest	冻结再投资份额	N	(16, 2)	Y		

5.4 投资者权益相关的交易类确认数据

5.4.1 业务明细

5.4.1.1 认购确认

认购确认数据内容和格式见表6。

表6 认购确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式, 则用销售商代码作为网点号码; 否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据GB/T 12406—2008中的3位数字代码, 例如: 156—人民币, 840—美元 344—港元, 954—欧元 392—日元, 826—英镑 250—法郎, 280—马克等。
9	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
10	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	N		
11	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	

表6 认购确认数据的数据内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
12	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
13	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为: HHMMSS
14	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
15	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
16	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
17	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		TA 对每笔确认的唯一标识。
18	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
19	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		含所有费用的总金额。

5.4.1.2 基金成立

基金成立数据内容和格式见表7。

表7 基金成立数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式,则用销售商代码作为网点号码;否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复。
8	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的3位数字代码,例如:156-人民币,840-美元344-港元,954-欧元392-日元,826-英镑250-法郎,280-马克等。
9	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)	N		包括利息折算的份额。
10	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		含所有费用的总金额,不含利息。
11	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD, 指交易申请日期。

表7 基金成立数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
12	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
13	ApplicationAmount	申请金额	N	(16,2)	N		经认购一次确认后的金额，非原始申请金额。
14	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
15	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
16	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
17	Charge	手续费	N	(10,2)	N		投资者应付总手续费。
18	AgencyFee	代理费	N	(10,2)	N		手续费中划归销售人的部分
19	Interest	基金账户利息	N	(10,2)	N		认购一次确认的金额在整个计息周期中产生的利息。
20	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		指交易申请时间，格式为：HHMMSS。
21	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
22	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		TA 对每笔确认的唯一标识
23	StampDuty	印花税	N	(16,2)	Y		
24	RaiseInterest	认购期间利息	N	(16,2)	N		因认购二次确认失败而退还给投资者的利息。
25	InterestTax	利息税	N	(16,2)	N		
26	TransferFee	过户费	N	(10,2)	N		
27	VolumeByInterest	基金账户利息金额转份额	N	(16,2)	N		
28	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10,2)	N		
29	NAV	基金单位净值	N	(7,4)	N		
30	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7,4)	N		
31	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	

5.4.1.3 申购确认

申购确认（含定期定额申购确认）数据内容和格式见表8。

表8 申购确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		未确知此账号时，填以空格，比如当天开户。
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。

表 8 申购确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复。
8	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码,例如:156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克等。
9	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
10	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	N		
11	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
12	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
13	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为: HHMMSS
14	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
15	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
16	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
17	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		TA 对每笔确认的唯一标识。
18	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
19	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)	N		
20	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		含所有费用的总金额。
21	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标志	C	1	Y	DIM20	
22	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	N		
23	Charge	手续费	N	(10, 2)	N		投资者应付总手续费。
24	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	N		手续费中划归销售人的部分。
25	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	N		
26	OtherFee1	其他费用 1	N	(10, 2)	Y		
27	OtherFee3	其他费用 3	N	(16, 2)	Y		
28	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	Y		
29	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
30	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	N		
31	OtherFee2	其他费用 2	N	(16, 2)	Y		
32	VarietyCodeOfPeriodicSubs	定期定额品种代码	C	5	Y		
33	SerialNoOfPeriodicSubs	定期定额申购序号	N	5	Y		

5.4.1.4 赎回确认

赎回确认（含强行赎回确认及预约赎回确认）数据内容和格式见表9。

表9 赎回确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复。
8							
9	LargeRedemptionFlag	巨额申赎处理方式代码	C	1	N	DIM19	
10	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
11	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)	N		
12	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
13	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
14	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码，例如：156—人民币，840—美元 344—港元，954—欧元 392—日元，826—英镑 250—法郎，280—马克等。
15	OriginalSerialNo	原 TA 确认交易流水号	C	20	Y		指定赎回时指明针对哪一笔的原确认流水号。
16	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为：HHMMSS
17	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
18	RedemptionDateInAdvance	预约赎回日期	A	8	Y		格式为：YYYYMMDD
19	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期	A	8	Y		指定赎回时指明针对哪一个过户日的赎回。
20	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
21	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
22	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		
23	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
24	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)	N		
25	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		为投资者实得金额，不含手续费，含业绩补偿，对货币基金含已兑付的收益。

表9 赎回确认数据的数据内容和格式(续)

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
26	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标志	C	1	Y	DIM20	
27	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7,4)	Y		
28	Charge	手续费	N	(10,2)	N		投资者应付总手续费。
29	AgencyFee	代理费	N	(10,2)	N		手续费中划归销售人的部分。
30	NAV	基金单位净值	N	(7,4)	N		
31	OtherFee1	其他费用1	N	(10,2)	N		
32	OtherFee3	其他费用3	N	(16,2)	Y		
33	StampDuty	印花税	N	(16,2)	N		
34	TransferFee	过户费	N	(10,2)	N		
35	AchievementPay	业绩报酬	N	(16,2)	Y		该值为正数
36	AchievementPayFlag	业绩报酬正负标志	C	1	Y	DIM23	负数表示业绩补偿。
37	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未付收益金额	N	(16,2)	Y		货币基金时,为必填。
38	UndistributeMonetaryIncomeFlag	货币基金未付收益金额正负标志	C	1	Y	DIM11	货币基金时,为必填。
39	DetailFlag	数据明细标志	A	1	Y	DIM14	对一笔赎回申请,可以返回一笔汇总确认,或一笔汇总确认和多笔明细确认。明细确认是针对过户日或TA确认交易流水号的确认记录。
40	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10,2)	N		
41	OtherFee2	其他费用2	N	(16,2)	Y		
42	RateFee	费率	N	(9,8)	Y		
43	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志	A	1	Y	DIM21	
44	GeneralTASerialNO	总TA确认交易流水号	C	20	Y		用于发送交易明细。
45	RedemptionReason	强制赎回原因类型代码	A	1	Y	DIM22	

5.4.1.5 基金转换确认

基金转换确认(含基金转换转入确认及基金转换转出确认)数据内容和格式见表10。

表10 基金转换确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		

表 10 基金转换确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式,则用销售商代码作为网点号码;否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	DiscountRateOfCommission	销售佣金折扣率	N	(5,4)	N		指销售人申报的转换费的折扣率,不是补差费折扣率。
9	CodeOfTargetFund	转换目标基金代码	C	6	N		
10	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
11	ApplicationVol	申请份额	N	(16,2)	N		申请的转出基金份额。
12	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
13	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497—1992 确定的交易所在地区代码。
14	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为: HHMMSS
15	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
16	TotalBackendLoad	交易后端收费	N	(16,2)	Y		
17	DetailFlag	数据明细标志	A	1	Y	DIM14	
18	TargetShareType	对方基金份额类别代码	C	1	N	DIM24	
19	TargetTAAccountID	对方基金账户编码	A	12	Y		跨 TA 基金转换、非交易过户和跨市场转托管时使用。
20	TargetRegistrarCode	对方 TA 代码	A	2	Y		跨 TA 基金转换时为“N”。
21	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
22	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
23	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		TA 对每笔确认的唯一标识
24	CfmVolOfTargetFund	目标基金的确认份数	N	(16,2)	N		确认的转入基金份额。
25	TargetNAV	目标基金的单位净值	N	(7,4)	N		转入基金净值
26	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
27	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16,2)	N		
28	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16,2)	Y		为投资者实得金额,不含手续费,含业绩补偿,对货币基金含已兑付的收益。
29	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7,4)	N		
30	Charge	手续费	N	(10,2)	N		投资者应付总手续费

表 10 基金转换确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
31	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	N		手续费中划归销售人的部分。
32	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	N		
33	OtherFee1	其他费用 1	N	(10, 2)	N		
34	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	N		
35	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
36	RecuperateFee	补差费	N	(16, 2)	N		
37	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码，例如：156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克等。
38	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	N		
39	GeneralTASerialNO	总 TA 确认交易流水号	C	20	Y		用于发送交易明细。

5.4.1.6 募集失败

募集失败数据内容和格式见表11。

表 11 募集失败数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
8	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码，例如：156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克等。
9	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		取值为 0
10	Interest	基金账户利息	N	(10, 2)	N		认购一次确认的金额在整个计息周期中产生的利息。

表 11 募集失败数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
11	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
12	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	N		经认购一次确认后的金额，非原始申请金额。
13	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
14	InterestTax	利息税	N	(16, 2)	N		
15	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	Y		
16	RaiseInterest	认购期间利息	N	(16, 2)	N		因基金募集失败而退还给投资者的利息。
17	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		
18	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992 确定的交易所在地区代码。
19	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为：HHMMSS
20	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
21	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
22	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	N	DIM18	

5.4.1.7 ETF 申购一次确认

交易型开放式指数基金（Exchange Traded Funds，以下简称“ETF”）申购一次确认数据内容和格式见表12。

表 12 ETF 申购一次确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992 确定的交易所在地区代码。

表 12 ETF 申购一次确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406 — 2008中的3位数字代码，例如：156-人民币，840-美元344-港元，954-欧元392-日元，826-英镑250-法郎，280-马克等。
10	Charge	手续费	N	(10, 2)	N		
11	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	N		
12	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	Y		
13	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		含所有费用的总金额
14	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
15	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为：HHMMSS
16	OtherFee1	其他费用1	N	(10, 2)	Y		
17	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
18	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
19	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	N		
20	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
21	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	Y		
22	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	Y		
23	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
24	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	N	DIM18	
25	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
26	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		
27	OtherFee2	其他费用 2	N	(16, 2)	Y		
28	OtherFee3	其他费用 3	N	(16, 2)	Y		

5.4.1.8 ETF 申购二次确认

ETF申购二次确认数据内容和格式见表13。

表 13 ETF 申购二次确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。

表13 ETF赎回一次确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992确定的交易所在地区代码。
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406 — 2008中的3位数字代码，例如：156-人民币，840-美元344-港元，954-欧元392-日元，826-英镑250-法郎，280-马克等。
10	Charge	手续费	N	(10, 2)	N		
11	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	N		
12	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	Y		
13	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)	N		
14	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	N		含所有费用的总金额。
15	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	N		
16	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
17	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为：HHMMSS
18	OtherFee1	其他费用1	N	(10, 2)	Y		
19	OtherFee2	其他费用2	N	(16, 2)	Y		
20	OtherFee3	其他费用3	N	(16, 2)	Y		
21	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
22	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
23	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)	Y		
24	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	N		
25	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
26	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	Y		
27	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标志	C	1	N	DIM20	
28	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	Y		
29	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
30	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	N	DIM18	
31	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
32	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		

5.4.1.9 ETF 赎回一次确认

ETF赎回一次确认数据内容和格式见表14。

表 14 ETF 赎回一次确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式, 则用销售商代码作为网点号码; 否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992 确定的交易所在地区代码。
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406 — 2008 中的 3 位数字代码, 例如: 156-人民币, 840-美元 344-港元, 954-欧元 392-日元, 826-英镑 250-法郎, 280-马克等。
10	ConfirmedVol	交易确认份数	N		N		
11	LargeRedemptionFlag	巨额申赎处理方式代码	C	1	N	DIM19	
12	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
13	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为: HHMMSS
14	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
15	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	
16	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)	N		
17	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
18	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
19	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志	A	1	Y	DIM21	
20	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
21	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		
22	OriginalSerialNo	原 TA 确认交易流水号	C	20	Y		
23	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期	A	8			
24	DetailFlag	数据明细标志	A	1	Y	DIM14	
25	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	N		

5.4.1.10 ETF 赎回二次确认

ETF赎回二次确认数据内容和格式见表15。

表 15 ETF 赎回二次确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	N		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	N		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	N		若销售商采用通买通卖的大集中方式,则用销售商代码作为网点号码;否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	N		投资者在销售机构内开设的用于交易的账号。
5	FundCode	基金代码	C	6	N		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	N	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	N		同一销售机构不能重复
8	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	Y		根据 GB/T 13497 — 1992 确定的交易所在地区代码。
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3	N		根据 GB/T 12406 — 2008 中的3位数字代码,例如:156-人民币,840-美元 344-港元,954-欧元 392-日元,826-英镑 250-法郎,280-马克等。
10	Charge	手续费	N	(10,2)	N		
11	AgencyFee	代理费	N	(10,2)	N		
12	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16,2)	N		
13	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16,2)	N		为投资者实得金额,不含手续费。
14	NAV	基金单位净值	N	(7,4)	N		
15	OriginalSerialNo	原 TA 确认交易流水号	C	20	Y		
16	TransactionDate	交易发生日期	A	8	N		格式为: YYYYMMDD
17	TransactionTime	交易发生时间	A	6	N		格式为: HHMMSS
18	OtherFee1	其他费用 1	N	(10,2)	N		
19	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	Y	DIM02	
20	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	N	DIM16	

表 15 ETF 赎回二次确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	是否可为空	代码取值	说明
21	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)	N		
22	BusinessCode	业务类型代码	A	3	N	DIM17	
23	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	N		
24	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	Y	DIM18	
25	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	N		格式为：YYYYMMDD
26	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	N		
27	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	N		
28	LargeRedemptionFlag	巨额申赎处理方式代码	C	1	N	DIM19	
29	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	Y		
30	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志	A	1	Y	DIM21	
31	DetailFlag	数据明细标志	A	1	Y	DIM14	
32	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	N		
33	GeneralTASerialNO	总 TA 确认交易流水号	C	20	Y		用于发送交易明细

5.4.2 数据内容

交易类确认数据内容和格式见表16。

表 16 交易类确认数据的数据内容和格式

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值	说明
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12		
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3		
3	BranchCode	销售网点编码	A	9		若销售商采用通买通卖的大集中方式，则用销售商代码作为网点号码；否则给出二级机构编号。
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17		
5	FundCode	基金代码	C	6		
6	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	DIM13	
7	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24		
8	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8		

表 16 交易类确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值	说明
9	CurrencyType	结算币种代码	A	3		根据 GB/T 12406—2008 中的 3 位数字代码，例如：156-人民币，840-美元 344-港元，954-欧元 392-日元，826-英镑 250-法郎，280-马克等。
10	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)		
11	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)		
12	LargeRedemptionFlag	巨额申赎处理方式代码	C	1	DIM19	
13	TransactionDate	交易发生日期	A	8		
14	TransactionTime	交易发生时间	A	6		
15	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	DIM16	
16	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)		
17	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)		
18	BusinessCode	业务类型代码	A	3	DIM17	
19	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20		
20	DiscountRateOfCommission	销售佣金折扣率	N	(5, 4)		
21	RegionCode	交易所在地区代码	A	4		根据 GB/T13497—1992 确定的交易所在地区代码。
22	Charge	手续费	N	(10, 2)		
23	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)		
24	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)		
25	OtherFee1	其他费用 1	N	(10, 2)		
26	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	DIM02	
27	RedemptionDateInAdvance	预约赎回日期	A	8		
28	StampDuty	印花税	N	(16, 2)		
29	OriginalSerialNo	原 TA 确认交易流水号	C	20		
30	Interest	基金账户利息	N	(10, 2)		
31	VolumeByInterest	基金帐户利息金额转份额	N	(16, 2)		
32	InterestTax	利息税	N	(16, 2)		
33	TargetNAV	目标基金的单位净值	N	(7, 4)		
34	CfmVolOfTargetFund	目标基金的确认份数	N	(16, 2)		

表 16 交易类确认数据的数据内容和格式（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值	说明
35	OtherFee2	其他费用 2	N	(16, 2)		
36	OtherFee3	其他费用 3	N	(16, 2)		
37	TransferFee	过户费	N	(10, 2)		
38	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	DIM18	
39	DetailFlag	数据明细标志	A	1	DIM14	
40	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志	A	1	DIM21	
41	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期	A	8		
42	RedemptionReason	强制赎回原因类型代码	A	1	DIM22	
43	CodeOfTargetFund	转换目标基金代码	C	6		
44	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)		
45	VarietyCodeOfPeriodicSubs	定期定额品种代码	C	5		
46	SerialNoOfPeriodicSubs	定期定额申购序号	C	5		
47	TargetTAAccountID	对方基金账户编码	A	12		
48	TargetRegistrarCode	对方 TA 代码	A	2		
49	TargetShareType	对方基金份额类别代码	C	1	DIM24	
50	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)		
51	RecuperateFee	补差费	N	(16, 2)		
52	AchievementPay	业绩报酬	N	(16, 2)		该值必须为正数。
53	AchievementPayFlag	业绩报酬正负标志	C	1	DIM23	负数表示业绩补偿。
54	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未付收益金额	N	(16, 2)		
55	UndistributeMonetaryIncomeFlag	货币基金未付收益金额正负标志	C	1	DIM11	

附 录 A
(规范性附录)
数据字典

数据字典内容见表A.1。

表 A.1 数据字典

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值/备注
1	TAAccountID	投资者基金账户编码	A	12	
2	DistributorCode	销售机构编码	C	3	
3	BranchCode	销售网点编码	A	9	
4	TransactionAccountID	投资者交易账户编码	A	17	
5	Address	通讯地址	C	60	
6	InstReprIDCode	法定代表人身份证号码	C	18	
7	InstReprIDType	法定代表人证件类型代码	C	1	DIM01
8	InstReprName	法定代表人姓名	C	20	
9	CertificateNo	投资者证件号码	C	30	
10	InvestorName	投资者账户名称	C	60	
11	IndividualOrInstitution	个人/机构标志	A	1	DIM02
12	EducationLevel	投资者学历	C	2	
13	PostCode	投资者邮政编码	A	6	
14	TransactorCertNo	经办人证件号码	C	18	
15	TransactorCertType	经办人证件类型代码	C	1	DIM01
16	TransactorName	经办人姓名	C	20	
17	InvestorsBirthday	投资者出生日期	A	8	
18	RegionCode	交易所在地区代码	A	4	
19	EmailAddress	投资者电子邮箱	C	40	
20	FaxNo	投资者传真号码	C	24	
21	HomeTelNo	投资者住址电话	C	22	
22	MobileTelNo	投资者移动电话	C	24	
23	AccountAbbr	投资者户名简称	C	12	
24	ConfidentialDocumentCode	密函编号	C	8	
25	Sex	投资者性别代码	A	1	DIM03
26	SHSecuritiesAccountID	上海证券账户编码	C	10	
27	SZSecuritiesAccountID	深圳证券账户编码	C	10	
28	TelNo	投资者电话号码	C	22	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值/备注
29	TradingMethod	渠道类别代码	C	8	共 8 个字符，每个字符代表一种交易手段，其含义为：第 1 位：CALLCENTER；第 2 位：INTERNET；第 3 位：自助终端；第 4 位：柜台；第 5~8 位：保留；每个字符取 1 表示使用此种手段，取 0 表示不使用。
30	MinorFlag	未成年人标志	C	1	
31	TransactorIDType	经办人识别方式代码	C	1	DIM04
32	MultiAcctFlag	多渠道开户标志	A	1	DIM05
33	DeliverWay	对账单寄送方式代码	C	8	
34	NetNo	操作（清算）网点编码	C	9	
35	FrozenCause	冻结原因代码	A	1	DIM06
36	FreezingDeadline	冻结截止日期	A	8	
37	AccountStatus	基金账户状态代码	C	1	DIM07
38	TransactionAccountStatus	交易账户状态代码	C	1	DIM08
39	FundCode	基金代码	C	6	
40	UpdateDate	基金净值日期	A	8	
41	FundName	基金名称	C	40	
42	TotalFundVol	基金总份数	N	(16, 2)	
43	FundStatus	基金状态代码	C	1	DIM09
44	NAV	基金单位净值	N	(7, 4)	
45	AccumulativeNAV	累计基金单位净值	N	(7, 4)	
46	FundSize	基金规模	N	(16, 2)	
47	CurrencyType	结算币种代码	A	3	
48	DefDividendMethod	默认分红方式代码	A	1	DIM10
49	RegistrarCode	基金份额登记机构编码	A	2	
50	TotalDivident	累计单位分红	N	(8, 5)	
51	FundType	基金类型代码	C	2	DIM12
52	ShareClass	基金收费方式代码	C	1	DIM13
53	AvailableVol	持有人可用基金份数	N	(16, 2)	
54	TotalVolOfDistributorInTA	基金总份数	N	(16, 2)	含冻结份数
55	TransactionCfmDate	交易确认日期	A	8	
56	TotalFrozenVol	基金冻结总份数	N	(16, 2)	
57	TASerialNO	TA 确认交易流水号	A	20	
58	TotalBackendLoad	交易后端收费	N	(16, 2)	
59	DetailFlag	数据明细标志	A	1	DIM14
60	ShareRegisterDate	份额注册日期	A	8	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值/备注
61	UndistributeMonetaryIncome	货币基金未付收益金额	N	(16, 2)	
62	UndistributeMonetaryIncomeFlag	货币基金未付收益金额正负标志	C	1	DIM11
63	GuaranteedAmount	剩余保本金额	N	(16, 2)	
64	SourceType	份额原始来源代码	C	1	DIM15
65	BasisforCalculatingDividend	基金分红基数	N	(16, 2)	
66	VolOfDividendforReinvestment	基金账户红利再投资基金份数	N	(16, 2)	
67	DividentDate	权益发放日期	A	8	
68	DividendAmount	基金账户红利资金	N	(16, 2)	
69	XRDate	除权日	A	8	
70	ConfirmedAmount	交易确认金额	N	(16, 2)	
71	RegistrationDate	权益登记日期	A	8	
72	BusinessCode	业务类型代码	A	3	DIM17
73	DividendPerUnit	单位基金分红金额	N	(16, 2)	
74	Charge	手续费	N	(10, 2)	
75	AgencyFee	代理费	N	(10, 2)	
76	OtherFee1	其他费用 1	N	(10, 2)	
77	OtherFee2	其他费用 2	N	(16, 2)	
78	StampDuty	印花税	N	(16, 2)	
79	FrozenBalance	冻结金额	N	(16, 2)	
80	TransferFee	过户费	N	(10, 2)	
81	FrozenSharesforReinvest	冻结再投资份额	N	(16, 2)	
82	AppSheetSerialNo	申请编号	C	24	
83	ConfirmedVol	交易确认份数	N	(16, 2)	
84	LargeRedemptionFlag	巨额申赎处理方式代码	C	1	DIM19
85	TransactionDate	交易发生日期	A	8	
86	TransactionTime	交易发生时间	A	6	
87	ReturnCode	交易处理返回代码	A	4	DIM16
88	ApplicationVol	申请份额	N	(16, 2)	
89	ApplicationAmount	申请金额	N	(16, 2)	
90	BusinessFinishFlag	业务过程完全结束标志	C	1	DIM20
91	DiscountRateOfCommission	销售佣金折扣率	N	(5, 4)	
92	RedemptionDateInAdvance	预约赎回日期	A	8	
93	OriginalSerialNo	原 TA 确认交易流水号	C	20	
94	Interest	基金账户利息	N	(10, 2)	

表 A.1 数据字典（续）

序号	字段标识	字段中文名	字段类型	字段长度	代码取值/备注
95	VolumeByInterest	基金帐户利息金额转份额	N	(16, 2)	
96	InterestTax	利息税	N	(16, 2)	
97	TargetNAV	目标基金的单位净值	N	(7, 4)	
98	CfmVolOfTargetFund	目标基金的确认份数	N	(16, 2)	
99	OtherFee3	其他费用 3	N	(16, 2)	
100	FromTAFlag	注册登记人发起业务标志	A	1	DIM18
101	OriginalCfmDate	TA 的原确认日期	A	8	
102	RedemptionInAdvanceFlag	预约赎回标志	A	1	DIM21
103	RedemptionReason	强制赎回原因类型代码	A	1	DIM22
104	CodeOfTargetFund	转换目标基金代码	C	6	
105	TotalTransFee	交易确认费用合计	N	(10, 2)	
106	VarietyCodeOfPeriodicSubs	定期定额品种代码	C	5	
107	SerialNoOfPeriodicSubs	定期定额申购序号	C	5	
108	TargetTAAccountID	对方基金账户编码	A	12	
109	TargetRegistrarCode	对方 TA 代码	A	2	
110	TargetShareType	对方基金份额类别代码	C	1	DIM24
111	ManagerRealRatio	实际计算折扣	N	(7, 4)	
112	RecuperateFee	补差费	N	(16, 2)	
113	GeneralTASerialNO	总 TA 确认交易流水号	C	20	
114	RaiseInterest	认购期间利息	N	(16, 2)	
115	RateFee	费率	N	(9, 8)	
116	AchievementPay	业绩报酬	N	(16, 2)	
117	AchievementPayFlag	业绩报酬正负标志	C	1	

附 录 B
(规范性附录)
代码取值及描述

B.1 证件类型代码

证件类型代码取值见表B.1。

表 B.1 证件类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证件类型代码/DIM01	01	身份证
	02	护照
	03	港澳居民来往内地通行证
	04	台湾居民来往大陆通行证
	05	军官证
	06	解放军士兵证
	07	武警士兵证
	08	户口本
	09	解放军文职干部证
	10	武警文职干部证
	11	警官证
	12	社会保障号
	13	外国人永久居留证
	14	外国护照
	15	临时身份证
	16	其他人员证件
	17	组织机构代码（即技术监督局代码
	18	工商营业执照
	19	社团法人注册登记证书
	20	机关事业法人成立批文
	21	批文
	22	军队凭证
	23	武警凭证
	24	基金会凭证
	25	特殊法人注册号
	26	统一社会信用代码
	27	行政机关
	28	社会团体

表 B.1 证件类型代码取值（续）

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
证件类型代码/DIM01	29	下属机构（具有主管单位批文号）
	30	其他机构证件号
	31	营业执照（产品管理人营业执照）
	32	登记证书
	33	其他

B.2 个人/机构标志

个人/机构标志代码取值见表B.2。

表 B.2 个人/机构标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
个人/机构标志/DIM02	0	机构
	1	个人

B.3 投资者性别代码

投资者性别代码取值见表B.3。

表 B.3 投资者性别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
投资者性别代码/DIM03	0	女
	1	男

B.4 经办人识别方式代码

经办人识别方式代码取值见表B.4。

表 B.4 经办人识别方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
经办人识别方式代码/DIM04	1	书面委托
	2	印鉴
	3	密码
	4	证件
	9	其他

B.5 多渠道开户标志

多渠道开户标志代码取值见表B.5。

表 B.5 多渠道开户标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
多渠道开户标志/DIM05	0	首次开设基金账户
	1	已经其它渠道开户

B.6 冻结原因代码

冻结原因代码取值见表B.6。

表 B.6 冻结原因代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
冻结原因代码/DIM06	0	司法冻结
	1	主动冻结
	2	质押冻结
	3	柜台冻结
	4	质押、司法双重冻结
	5	柜台、司法双重冻结

B.7 基金账户状态代码

基金账户状态代码取值见表B.7。

表 B.7 基金账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
基金账户状态代码/DIM07	0	正常
	1	冻结
	2	挂失
	3	注销
	4	挂账
	5	休眠

B.8 交易账户状态代码

交易账户状态代码取值见表B.8。

表 B.8 交易账户状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
交易账户状态代码/DIM08	0	正常
	3	注销

B.9 基金状态代码

基金状态代码取值见表B.9。

表 B.9 基金状态代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
基金状态代码/DIM09	0	可申购赎回
	1	发行
	4	停止申购赎回
	5	停止申购
	6	停止赎回
	8	基金终止
	9	基金封闭

B.10 默认分红方式代码

默认分红方式代码取值见表B.10。

表 B.10 默认分红方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
默认分红方式代码/DIM10	0	红利转投
	1	现金分红
	2	按投资者分红方式
	4	部分再投资

B.11 货币基金未付收益金额正负标志

货币基金未付收益金额正负标志代码取值见表B.11。

表 B.11 货币基金未付收益金额正负标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
货币基金未付收益金额正负标志/DIM11	0	正
	1	负

B.12 基金类型代码

基金类型代码取值见表B.12。

表 B.12 基金类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
基金类型代码/DIM12	01	股票型
	02	债券型
	03	混合型
	04	货币型
	05	其他公募类

B.13 基金收费方式代码

基金收费方式代码取值见表B.13。

表 B.13 基金收费方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
基金收费方式代码/DIM13	0	前收费
	1	后收费

B.14 数据明细标志

数据明细标志代码取值见表B.14。

表 B.14 数据明细标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
数据明细标志/DIM14	0	汇总
	1	明细

B.15 份额原始来源代码

份额原始来源代码取值见表B.15。

表 B.15 份额原始来源代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
份额原始来源代码/DIM15	0	认购
	1	申购
	2	定期定额申购
	3	分红

B.16 交易处理返回代码

交易处理返回代码取值见表B.16。

表 B.16 交易处理返回代码取值

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0000	成功
	0001	份数余额不足
	0002	账户已冻结
	0003	账户已挂失
	0004	发行期不受理

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0005	封闭期不受理
	0006	非开放日不受理
	0007	收到预约数据确认
	0008	巨额不受理
	0009	无此账户
	0010	其它原因失败
	0100	证件号码错误 (包括无证件号码)
	0101	证件号码重复
	0102	地区号无效
	0103	业务种类非法
	0104	销售人交易基金账号非法
	0105	销售代理人代码错误
	0106	无户名
	0107	个人/法人标志非法
	0108	证件类型非法
	0109	无经办人姓名
	0110	经办人证件类型非法 (包括无经办人证件类型)
	0111	经办人证件号码错误
	0112	无通讯地址
	0113	邮政编码非法 (包括无邮政编码)
	0114	无电话
	0115	无住址电话
	0116	无单位电话
	0117	开户网点非法
	0118	冻结挂失截止日期无效
	0119	无 E-MAIL 地址
	0120	无法人代表姓名
	0121	法人代表证件类型代码非法
	0122	法人身份证件代码非法 (包括无法人身份证件代码)
	0123	基金账号非法 (包括无基金账号)
	0124	密函编号非法 (包括无密函编号)
	0125	职业代码非法
	0126	学历代码无效

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0127	年收入代码
	0128	性别非法
	0129	出生日期非法
	0130	传真号码非法
	0131	手机号码非法
	0132	传呼机号码非法
	0133	交收行代码非法
	0134	交收行账户名非法
	0135	交收行账号非法
	0136	上交所账号非法
	0137	深交所账号非法
	0138	开户日期非法
	0139	申请编号非法 (包括无申请编号)
	0140	冻结标志非法
	0141	默认分红方式非法
	0200	基金代码非法
	0201	交易日期非法
	0202	交易时间非法
	0203	销售人流水号非法
	0204	结算币种代码非法
	0205	资金账号非法
	0206	交易数量非法
	0207	交易金额非法
	0208	对方销售人基金账号非法
	0209	受理日期已变为下一个工作日
	0210	对方基金账号非法
	0211	过户代理地点代码非法
	0212	股东账户代码非法
	0213	指定券商席位号非法
	0214	预约赎回日期非法
	0215	网点号非法
	0216	折扣率非法
	0217	有效天数非法
	0218	原申请编号非法
	0219	巨额申赎处理方式代码非法
	0220	冻结原因非法
	0221	对方网点号非法
	0222	再投资类型非法

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0223	目标基金代码非法
	0224	手续费率非法
	0225	手续费非法
	0226	对方销售机构编码非法
	0227	原申购日期非法
	0228	账户未挂失
	0229	账户未冻结
	0301	账户申请日期无效
	0302	账户申请不存在
	0303	投资人已注册基金账户
	0304	账户申请注册失败
	0305	赎回份数过小
	0306	因投资人未在转入方开户致使转销售人/机构失败
	0307	持有份数超过持有上限
	0308	基金账户已注销
	0309	单笔申购低于申购下限
	0310	赎回后剩余份数低于持有下限
	0311	转出方余额不足
	0312	确认异常
	0313	投资人名或证件类型或证件代码与股东资料不符
	0314	基金账户已挂账
	0315	证券账户不存在
	0316	基金账户不存在
	0317	基金非认购期
	0318	基金非申购期
	0319	基金非赎回期
	0320	基金禁止转销售人/机构
	0321	证券账户已注册为基金账户
	0322	基金账户有转托基金的冻结份数能单只基金全部转销售人/机构
	0323	有在途份数，不能全转销售人/机构
	0324	转出方余额为零
	0325	原申请日期无效
	0326	转入转出是同一代理人
	0327	销售代理人不能代理此基金
	0328	销售代理人无效
	0329	性别代码无效
	0330	申请日期无效
	0331	投资人名无效

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0332	投资人证件类型无效
	0333	投资人证件号码无效
	0334	通讯地址无效
	0335	法人代表姓名无效
	0336	经办人姓名无效
	0337	单笔认购低于认购下限
	0338	单笔认购高于认购上限
	0339	基金处于权益分配期间，不允许更改分红方式
	0340	单笔赎回高于预约下限
	0341	单笔赎回低于赎回下限
	0342	取基金信息错误
	0343	写权益登记错误
	0344	写基金明细表出错
	0345	撤单申请无效
	0346	转销售人/机构类型错
	0347	转销售人/机构类型与申报数据不符
	0348	旧基金账号个人资料不存在
	0349	旧基金账号机构资料不存在
	0350	无效分红方式
	0351	该基金账号有份数不允许注销
	0352	赎回金额不足以支付手续费
	0353	证券账户类型非法
	0354	同一网点申报相同数据
	0355	管理人拒绝
	0356	管理人配售确认撤销
	0357	认购金额过少
	0358	经办人识别方式非法
	0359	CALLCENTER 交易标志非法
	0360	INTERNET 交易标志非法
	0361	账单寄送选择方式非法
	0362	有基金份数，销户非法
	0363	基金账号信息未作改动，拒绝申请
	0364	基金账号凭证号非法
	0365	有当日申请，销户非法
	0366	基金净值非法
	0367	转销售人/机构中转出与转入交易账户的基金账户不同
	0368	基金不能转入
	0369	基金不能转出
	0370	持有份数小于最低持有份数，应全部赎回或转换

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0371	税率非法
	0372	分红方案错误
	0373	基金发行失败，退回认购
	0374	该预约赎回单已失效
	0375	手续费分成非法
	0376	基金终止
	0377	基金不在发行期或认购结束，认购不受理
	0378	基金在正常交易期
	0379	基金已发行或发行失败
	0380	基金停止交易
	0381	基金停止申购
	0382	基金停止赎回
	0383	基金正在权益登记
	0384	红利发放，业务不受理
	0385	无法识别的基金状态
	0386	非交易过户对方账号未登记
	0387	本日有冻结、挂失申请，交易无效
	0388	一天仅接受一次重要资料修改
	0389	分红期间有在途权益，不能处理
	0390	基金账号已登记
	0391	基金账号未登记
	0392	该交易账号已开户
	0393	有重复的冻结申请
	0394	非交易过户必须逐笔确认
	0395	交易后，入方余额低于最低限制
	0396	交易后，出方余额低于最低限制
	0397	基金转换对方基金停止交易
	0398	基金无份数可冻结解冻
	0399	无此冻结申请
	0400	解冻份数与原冻结数不匹配
	0401	超过最高赎回份数限制
	0402	申购金额低于手续费
	0403	总份额已超过募集金额，不能再认购
	0404	按份数认购，金额计算错误
	0405	不允许机构认购
	0406	不允许个人认购
	0407	逐笔人工处理为无效
	0408	逐笔人工处理为成功
	0409	已撤单

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0410	巨额赎回延续部分
	0411	重复开户
	0412	不支持预约申请
	0413	有份数冻结，不允许账户冻结
	0414	没有指定赎回的基金份额
	0415	小于初次投资金额限制
	0416	小于追加投资限制
	0417	转销售人/机构对方销售商或网点不存在
	0418	不能修改客户类型
	0419	重要资料修改当天不能赎回转销售人/机构
	0420	申请日期大于最后认购日期
	0421	巨额赎回，不能基金转换
	0422	当天多次开户(交易账号重)
	0423	当天多次开户(基金账号重)
	0424	不存在要转出的份数
	0425	经办人识别方式非法
	0426	账单寄送选择方式非法
	0427	基金账号信息未作改动，拒绝申请
	0428	持有份数小于最低持有份数，应全部赎回或转换
	0429	分红方案错误
	0430	该预约赎回单已失效
	0431	持有份数小于等于最低赎回份数，应全部赎回或转换
	0432	基金在个人认购期，不接受机构认购
	0433	基金在机构认购期，不接受个人认购
	0434	认购金额小于机构最低认购金额
	0435	认购申请金额小于个人最低认购金额
	0436	认购金额大于机构最高认购金额
	0437	认购申请金额大于个人最高认购金额
	0438	基金处于不允许申购状态
	0439	申购申请金额小于机构最低追加投资金额
	0440	申购申请金额小于个人最低追加投资金额
	0441	申购申请金额小于机构最低首次投资金额
	0442	申购申请金额小于个人最低首次投资金额
	0443	定期定额申购申请金额小于最低定额
	0444	定期定额申购申请金额超出最低定额部分不是级差的整数倍
	0445	定期定额申购合约终止
	0446	定期定额申购金额与原合约不符
	0447	持有份数大于最低赎回份数，申请赎回份数不小于最低赎回份数
	0448	柜员登录注销错误

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0449	柜员代码不能为空
	0450	没有此柜员
	0451	此柜员已被冻结
	0452	此柜员已被删除
	0453	柜员密码不符
	0454	此柜员已经登录系统;或者此前非正常退出系统, 请与系统管理员联系
	0455	登录柜员记录出现异常, 请与系统管理员联系
	0456	注销柜员状态出现异常, 请与系统管理员联系
	0457	操作员过期
	0458	柜员管理类错误
	0459	柜员代码长度必须为 3 位
	0460	此柜员代码已经存在
	0461	柜员姓名不能为空
	0462	存在同名的有效柜员, 系统不允许姓名重复
	0463	柜员密码不能为空
	0464	柜员所属部门不能为空
	0465	有效天数必须是大于 0 的整数
	0466	起始日期不能为空
	0467	确认密码不能为空
	0468	组代码不能为空
	0469	组的成员已经存在
	0470	权限代码不能为空
	0471	组的权限已经存在
	0472	柜员的权限已经存在
	0473	组名称不能为空
	0474	此组已经存在
	0475	柜员角色不能为空
	0476	组非空不能删除
	0477	组的成员不存在
	0478	组的权限不存在
	0479	根用户不能删除
	0480	操作员代码不能为空
	0481	没有此组
	0482	此柜员代码不存在
	0483	确认密码不正确
	0484	修改柜员资料时柜员状态不允许被设置为“删除”
	0485	柜员已被删除, 操作被禁止
	0486	柜员处于活动状态, 操作被禁止

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0487	交易密码错误
	0488	交易账号凭证号错误
	0489	交易账户处于等待确认状态
	0490	交易账户已挂失
	0491	确认密码不正确
	0492	基金账户处于等待确认状态
	0493	当天有账户申请
	0494	当天有交易申请
	0495	案号非法
	0496	该交易申请已经提交
	0497	定期定额申购日期非法
	0498	定期定额申购类型错误
	0499	定期定额申购状态非法
	0500	该定期定额申购已完成
	0501	该定期定额申购已撤单
	0502	该定期定额申购已撤消
	0503	定期定额申请不存在或其它数据库错误
	0504	解冻份数大于已冻结份数
	0505	在同一工作日同一投资者有相同的更改基金分红方式申请
	0506	交易账户已作废
	0507	交易账户凭证号状态错误
	0508	交易账户已销户
	0509	交易账户已冻结
	0510	交易账户已撤销
	0511	交易账户待确认
	0512	交易账户未开基金账户
	0513	基金账户挂失
	0514	基金账户冻结
	0515	基金账户销户
	0516	转销售人/机构对方机构代码与发起机构代码相同
	0517	基金转换转出基金与目标基金相同
	0518	交易账户与基金账户不匹配
	0519	禁止此模式基金转换
	0520	存在逆向基金转换
	0521	无要复核的申请合同号
	0522	要复核的合同号不属于本机构
	0523	要复核的合同号不属于本网点
	0524	要复核的合同号业务类型不一致
	0525	复核人员与受理人员相同

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0526	要复核的合同号已复核
	0527	要复核的合同号已作废
	0528	要复核的合同号已撤单
	0529	复核流水的基金代码不对
	0530	复核流水的申请金额不对
	0531	复核流水的交易账号不对
	0532	写更改申请流水的复核标志失败
	0533	复核流水的操作员代码不对
	0534	复核流水的申请份额不对
	0535	复核流水的巨额赎回处理方式不对
	0536	复核流水的对方机构代码不对
	0537	复核流水的转换目标基金代码不对
	0538	复核流水的申请费用不对
	0539	复核流水的分红方式不对
	0540	复核流水的分红比例不对
	0541	无此交易码
	0542	该操作现不可用
	0543	该申请已撤单
	0544	该申请已作废
	0545	该申请还未复核
	0546	电话委托受理业务不能通过柜面撤单
	0547	该申请已复核
	0548	系统通用参数查询失败
	0549	查询表单列值信息失败
	0550	查询报表输出固定数据配置信息失败
	0551	查询表单输入条件的配置信息失败
	0552	未定义的表单查询
	0553	查询表单数据集信息失败
	0554	请选择输入查询表单号
	0555	未定义的查询类别
	0556	查询表单数据集信息失败
	0557	取申请账页失败
	0558	发布日期不能为空
	0559	利率生效时间非法
	0560	利率非法
	0561	利息税率非法
	0562	实施时间不能为空
	0563	最小手续费比率不能小于 0
	0564	最大手续费比率不能大于 1

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0565	最小手续费比率不能大于最大手续费比率
	0566	注册登记人手续费分成比率不能为空
	0567	此业务不能设置进入基金资产手续费比率
	0568	手续费分成比率不能大于最小手续费比率
	0569	手续费分成比率不能小于 0
	0570	权益登记日非法
	0571	除权日期非法
	0572	派息日非法
	0573	利得比例不能为空
	0574	利得比例必须在 0,1 之间
	0575	分红方案编码非法
	0576	费率方案编号不能为空
	0577	手续费计算方案起始时间非法
	0578	基金名称不能为空
	0579	基金状态非法
	0580	基金转换状态非法
	0581	基金认购价格非法
	0582	费率方案不完整
	0583	存在未确认记录，不能提交
	0584	此操作员未输入费率方案，不能输入费率
	0585	金额非法
	0586	持有天数非法
	0587	手续费率段重叠
	0588	此操作员未输入费率方案，不能删除费率
	0589	基金账户受理方式不能为空
	0590	不存在的基金账户受理方式
	0591	到账情况不能为空
	0592	证件唯一性不能为空
	0593	系统状态不能为空
	0594	强行签退时间不能为空
	0595	强行签退持续时间不能为空
	0596	强行签退持续时间不能小于 0
	0597	基金净值路径不能为空
	0598	销售点代码不能为空
	0599	清算日期不能为空
	0600	工作日期不能为空
	0601	巨额赎回比例不能为空
	0602	巨额赎回比例必须在 0-1 之间
	0603	未知的系统参数

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0604	定期定额申购日期不能为空
	0605	按定期定额申购日期错
	0606	印花税率非法
	0607	审批日期不能为空
	0608	审批人不能为空
	0609	审批数量不能为空
	0610	审批数量不能小于 0
	0611	批准的基金转换份数应小于等于基金总份数
	0612	待确认的记录超过一条
	0613	确认审批内容与第一次输入内容不符
	0614	不支持的基金发行方案
	0615	待确认的基金发行记录超过一条
	0616	到款日期不能为空
	0617	预售规模不能为空
	0618	预售规模不能小于 0
	0619	认购价格不能小于 0
	0620	销售机构设置错误
	0621	销售机构接收目录不能为空
	0622	销售机构发送目录不存在
	0623	销售机构接收目录不能为空
	0624	销售机构接收目录不存在
	0625	销售机构代码不能为空
	0626	销售机构名称不能为空
	0627	销售机构状态不能为空
	0628	销售机构类型不能为空
	0629	销售机构接受目录长度大于 120
	0630	销售机构发送目录长度大于 120
	0631	网点代码不能为空
	0632	网点名称不能为空
	0633	区域代码不能为空
	0634	区域代码不存在
	0635	银行名称不能为空
	0636	银行状态不能为空
	0637	公告状态不能为空
	0638	公告已输入，未复核
	0639	公告已复核成功
	0640	未定义的公告状态
	0641	此公告不存在
	0642	公告标题不能为空

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0643	公告日期不能为空
	0644	公告日期不能比当前日期小
	0645	公告内容不能为空
	0646	公告类型不能为空
	0647	取公告编号流水号失败
	0648	操作员相同，不能复核公告
	0649	操作员不同，不能修改公告
	0650	公告已经发布
	0651	公告复核错误
	0652	不支持的传输状态
	0653	未解上传包
	0654	未打包上传包
	0655	未解下传包
	0656	未打包下传包
	0657	包传输状态不存在
	0658	第一次输入
	0659	第一次删除
	0660	第一次修改
	0661	未生效
	0662	已生效
	0663	已实施
	0664	未知状态
	0665	记录只有一条
	0666	记录不存在
	0667	记录多于一条
	0668	不是本操作员输入，不能修改，请先清屏
	0669	本操作员输入，不能再次输入
	0670	不是本操作员输入，不能删除
	0671	第二次输入内容与第一次输入内容不符
	0672	第二次修改内容与第一次修改内容不符
	0673	数据库错误
	0674	写日志失败
	0675	取交易账户编号失败
	0676	取基金账户流水号失败
	0677	取系统日期失败
	0678	存在认购或未完成的赎回申请
	0679	清算步骤错误
	0680	取系统时间失败
	0681	取参数 ACCPTMD(受理方式)的值失败

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0682	取交易账号凭证流水号失败
	0683	取销售机构代码失败
	0684	存在冻结的基金份额
	0685	正在清算，不能处理到账操作
	0686	存在未审批的巨额赎回
	0687	取交易账号凭证号失败
	0688	取交易账号失败
	0689	取交易密码失败
	0690	取基金余额失败
	0691	更改余额失败
	0692	写资金回款流水失败
	0693	交易清算类型错误
	0694	取清算日失败
	0695	修改投资者基金分红信息失败
	0696	取市场标志失败
	0697	市场标志错误
	0698	现为收市状态，还未日初，不能进行业务受理
	0699	现为日终状态，还未日初，不能进行业务受理
	0700	系统步骤错误
	0701	取市场状态描述错误
	0702	设置市场状态错误
	0703	设置下一工作日错误
	0704	生成工作日表错误
	0705	系统日初错误
	0706	系统日终错误
	0707	设置上一工作日错误
	0708	取收市处理状态失败
	0709	收市处理步骤错误
	0710	取收市处理状态描述失败
	0711	设置收市处理状态失败
	0712	收市初始化错误
	0713	收市复核错误
	0714	收市写账页错误
	0715	取系统状态失败
	0716	取系统状态描述失败
	0717	设置系统状态失败
	0718	系统当前状态不允许操作
	0719	取清算处理状态失败
	0720	清算处理步骤错误

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0721	取清算处理状态描述失败
	0722	设置清算处理状态失败
	0723	清算初始化错误
	0724	清算数据备份错误
	0725	清算数据恢复错误
	0726	账户清算错误
	0727	交易清算错误
	0728	清算复核错误
	0729	清算结束错误
	0730	预清算错误
	0731	清算数据汇总错误
	0732	审批赎回份数大于允许的最大审批份数
	0733	审批申购份数大于允许的最大审批份数
	0734	基金未发生巨额或超规模不用进行审批
	0735	基金发生巨额或超规模请进行审批
	0736	取募集期日处理状态失败
	0737	募集期日处理步骤错误
	0738	取募集期日处理状态描述失败
	0739	设置募集期日处理状态失败
	0740	募集期日处理初始化错误
	0741	募集期日处理数据备份错误
	0742	募集期日处理数据检查错误
	0743	募集期日处理当日有效认购统计错误
	0744	募集期日处理错误
	0745	募集期日处理发行统计错误
	0746	募集期日处理数据汇总错误
	0747	募集期日处理复核开始错误
	0748	募集期日处理复核结束错误
	0749	募集期日处理数据恢复错误
	0750	募集期日处理结束错误
	0751	基金认购费率未设置或无有效费率
	0752	基金交易费率未设置或无有效费率
	0753	基金 NAV 值未设置或无有效 NAV 值
	0754	没有基金可进行募集处理
	0755	取发行处理状态失败
	0756	发行处理步骤错误
	0757	取发行处理状态描述失败
	0758	设置发行处理状态失败
	0759	发行处理初始化错误

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0760	发行处理数据备份错误
	0761	发行处理错误
	0762	发行处理复核开始错误
	0763	发行处理复核结束错误
	0764	发行处理数据恢复错误
	0765	发行处理结束错误
	0766	发行预处理错误
	0767	计算发行利息错误
	0768	发行失败处理错误
	0769	发行成功处理错误
	0770	利率未设置或不存在
	0771	没有基金可进行发行处理
	0772	分红方案非法
	0773	分红方案状态错误
	0774	取投资者分红信息错误
	0775	计算投资者分红权益错误
	0776	权益登记错误
	0777	红利发放错误
	0778	红利统计错误
	0779	统计认购清算确认数据错误
	0780	统计认购数据(给核算)错误
	0781	统计发行确认数据错误
	0782	统计发行确认数据(给核算)错误
	0783	汇总业务申请数据错误
	0784	汇总业务确认数据错误
	0785	汇总统计固定收费错误
	0786	读数据库失败，请查看错误日志
	0787	写数据库错误，请查看错误日志
	0788	数据操作失败，请查看系统日志
	0789	写交易申请流水失败
	0790	写账页失败
	0791	数据历史备份与清除失败
	0792	按申请编号检查申请数据错误
	0793	按基金状态检查申请数据错误
	0794	按申请数量检查申请数据错误
	0795	写确认流水错误
	0796	累计投资者认购金额错误
	0797	写认购队列错误
	0798	更改申请流水处理状态错误

表 B.16 交易处理返回代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
交易处理返回代码/DIM16	0799	系统错误
	9999	其它错误

B.17 业务类型代码

业务类型代码取值见表B.17。

表 B.17 业务类型代码取值

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
业务代码/DIM17	101	开户
	102	销户
	103	账户信息修改
	104	基金账户冻结
	105	基金账户解冻
	106	基金账户卡挂失
	107	基金账户卡解挂
	108	增加交易账户
	109	撤销交易账户
	120	认购
	121	预约认购
	122	申购
	123	预约申购
	124	赎回
	125	预约赎回
	126	转销售人/机构
	127	转销售人/机构转入
	128	转销售人/机构转出
	129	设置分红方式
	130	认购结果
	131	基金份额冻结
	132	基金份额解冻
	133	非交易过户
	134	非交易过户转入
	135	非交易过户转出
	136	基金转换
	137	基金转换转入
	138	基金转换转出
	139	定期定额申购

表 B.17 业务类型代码取值（续）

中文名称	代码取值编码	代码取值描述
业务代码/DIM17	140	退款
	141	补款
	142	强行赎回
	143	红利发放
	144	强行调增
	145	强行调减
	146	配号
	149	募集失败
	150	基金清盘
	151	基金终止
	152	撤单
	153	撤预约单
	154	无效资金
	155	基金销售人资金清算
	156	投资人资金清算
	157	红利解冻
	158	变更交易账号
	159	定期定额申购开通
	160	定期定额申购撤销
	161	定期定额申购修改
	162	认购配售
	191	ETF 基金申购一次
	192	ETF 基金申购二次
	193	ETF 基金赎回一次
	194	ETF 基金赎回二次

B.18 注册登记人发起业务标志

注册登记人发起业务标志代码取值见表B.18。

表 B.18 注册登记人发起业务标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
注册登记人发起业务标志/DIM18	0	由销售人发起
	1	由注册登记人发起

B.19 巨额申赎处理方式代码

巨额申赎处理方式代码取值见表B.19。

表 B.19 巨额申赎处理方式代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
巨额申赎处理方式代码/DIM19	0	取消
	1	顺延

B.20 业务过程完全结束标志

业务过程完全结束标志代码取值见表B.20。

表 B.20 业务过程完全结束标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
业务过程完全结束标志/DIM20	0	中间过程
	1	业务过程结束

B.21 预约赎回标志

预约赎回标志代码取值见表B.21。

表 B.21 预约赎回标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
预约赎回标志/DIM21	0	非预约赎回
	1	预约赎回

B.22 强制赎回原因类型代码

强制赎回原因类型代码取值见表B.22。

表 B.22 强制赎回原因类型代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
强制赎回原因类型代码/DIM22	0	小于最低持有数
	1	司法执行
	2	政策原因

B.23 业绩报酬正负标志

业绩报酬正负标志代码取值见表B.23。

表 B.23 业绩报酬正负标志代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
业绩报酬正负标志/DIM23	0	正
	1	负

B.24 对方基金份额类别代码

对方基金份额类别代码取值见表B.24。

表 B.24 对方基金份额类别代码取值

中文名称/代码	代码取值编码	代码取值描述
对方基金份额类别代码/DIM24	0	前收费
	1	后收费

参 考 文 献

- [1] JR/T 0017—2012 开放式基金业务数据交换协议[S]
-



中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0181—2020

期货合约要素

Futures contract elements

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言..... II

1 范围..... 1

2 规范性引用文件..... 1

3 术语和定义..... 1

4 期货合约的要素..... 1

参考文献..... 5

前 言

本标准依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本标准由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本标准由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本标准起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、中证信息技术服务有限责任公司、中国金融期货交易所。

本标准主要起草人：姚前、刘铁斌、周云晖、韩世满、何妍蕾、鲁晓、汤云龙、张翼飞、普丽芬、常鑫鑫、李向东、白利民、兰晓为、郝京一、武军伟。

期货合约要素

1 范围

本标准规定了期货合约所涉各要素的设计和编制要求。

本标准适用于期货交易所制定的期货合约，包括：商品期货合约、金融期货合约。

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，仅所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。

《期货交易管理条例》

《期货交易所管理办法》

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

期货合约 futures contract

期货交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。

注：期货合约包括商品期货合约和金融期货合约及其他期货合约。

3.2

商品期货合约 commodity futures contract

以农产品、工业品、能源和其他商品及其相关指数产品为标的物的期货合约。

3.3

金融期货合约 financial futures contract

以有价证券、利率、汇率等金融产品及其相关指数产品为标的物的期货合约。

4 期货合约的要素

4.1 合约名称

合约名称（Contract Name）是指某一期货合约的标题。

合约名称的表述：上市交易场所全称+该合约的基础资产名称+期货合约。

如以XX商品交易所玉米期货合约为例，合约名称为“XX商品交易所玉米期货合约”。

4.2 基础资产

基础资产（Underlying Assets）是指期货合约的标的物，又可称为交易品种、合约标的。

基础资产的表述：准确、完整、简洁地概括基础资产的名称，该基础资产具有国家强制性或推荐性标准的，应使用其标准中的规范性表述。

以XX期货交易所电解镍期货合约为例，交易品种为“电解镍”；又以XX金融期货交易所10年期国债期货合约为例，合约标的为“面值为100万元人民币、票面利率为3%的名义长期国债”。

4.3 交易单位

交易单位（Contract Size）是指由交易场所规定的期货合约单位和期货合约计量单位的统称，也称为合约规模。

交易单位的表述可分为两种情形：

- a) 单位数量+数量单位/手。其中，单位数量用阿拉伯数字表示；数量单位原则上应使用国际通行标准，如：吨、千克、克等。以XX期货交易所黄金期货合约为例，交易单位为“1000克/手”。
- b) 单位数量+货币单位。其中，单位数量用阿拉伯数字表示；货币单位原则上应使用国际通行标准，如：人民币、美元、欧元、日元等。

4.4 报价单位

报价单位（Price Quotation）是指期货合约报价所使用的单位，又可称为报价方式。

报价单位的表述可分为两种情形：

- a) 货币单位（币种）/数量单位，以XX商品交易所的玉米期货合约为例，报价单位为“元（人民币）/吨”。
- b) 按照股指期货、利率期货等不同性质，准确表述期货合约的报价单位，以XX金融期货交易所的沪深300指数期货合约为例，报价单位为“指数点”。

4.5 最小变动价位

最小变动价位（Minimum Price Fluctuation）是指期货合约的单位价格涨跌变动的最小值，在期货交易中，每次报价的变动数值应是最小变动价位的整数倍。

最小变动价位的表述可分为两种情形：

- a) 数额+报价单位，以XX商品交易所的优质强筋小麦期货合约为例，最小变动价位为“1元/吨”。
- b) 按照股指期货、利率期货等不同性质，准确表述期货合约的最小变动价位，以XX金融期货交易所的沪深300指数期货合约为例，最小变动价位为“0.2点”。

4.6 涨跌停板幅度

涨跌停板幅度（Daily Price Limit）是指期货合约在一个交易日中的交易价格不得高于或者低于规定的涨跌幅度，超过该涨跌幅度的报价将被视为无效，不能成交。一般是以前一交易日的结算价为基础确定的，又可称为每日价格最大波动限制。

涨跌停板幅度的表述：上一交易日结算价+百分比数额区间，如以XX商品交易所的焦煤期货合约为例，涨跌停板幅度为“上一交易日结算价4%”。

4.7 合约月份

合约月份（Contract Months）是指该期货合约标明进行交割的月份。

合约月份的表述应按照基础资产的性质和特点，准确表述期货合约月份，避免产生歧义，具体为：

- a) 采用“直接月份”式，以XX商品交易所玻璃期货合约为例，期货合约交割月份为“1-12月”；
- b) 采用“间接月份”式，以XX金融期货交易所的沪深300指数期货合约为例，期货合约交割月份为“当月、下月及随后两个季月”。

4.8 交易时间

交易时间 (Trading Hours) 是指以期货合约标的物进行交易活动的起止时间段。

交易时间的表述: 时间段+ (北京时间)+ 交易场所规定的其他交易时间。如: 上午9: 00~11: 30 下午1: 30~3: 00 (北京时间), 和交易场所规定的其他交易时间。

4.9 最后交易日

最后交易日 (Last Trading Day) 是指某期货合约进行交易的最后一个交易日。该交易日收盘后未平仓期货合约, 按规定进行实物交割或现金交割。

最后交易日的表述: 以期货合约交割月份为基础+ 单日设定方式表述。以XX商品交易所白糖期货合约为例, 最后交易日为“期货合约交割月份的第10个交易日”。

4.10 交割日期

交割日期 (Delivery Period) 是指以实物交割或现金交割方式了结未平仓期货合约的时间, 也可使用最后交割日方式对期货合约交割日期进行规定。

交割日期的表述: 按照交割方式的不同, 准确表述期货合约交割的时间段。以XX期货交易所黄金期货合约为例, 交割日期为“最后交易日后连续五个工作日”。

4.11 交割品级

交割品级 (Grade and Quality Specifications) 是指由期货交易所统一规定的、准许在期货交易所上市交易的期货合约标的物的质量要求, 适用于商品期货合约。

交割品级的表述包含直接表述法或间接指向法, 具体如下:

- a) 直接表述法是指在期货合约中直接描述交割品种的质量等级, 一般包含标准品品级与替代品品级, 并述明品种、适用标准等内容。以XX期货交易所阴极铜期货合约为例, 交割品级为“标准品: 阴极铜, 符合GB/T 467—2010中1号标准铜(Cu-CATH-2)规定, 其中主成份铜加银含量不小于99.95%。替代品: 阴极铜, 符合GB/T 467—2010中A级铜(Cu-CATH-1)规定。”
- b) 间接指向法是指在期货合约中指明适用的交割质量规定, 以转致适用该规定, 主要适用于交割所涉事项较多情况。以XX商品交易所黄大豆2号期货合约为例, 交割品级为“符合《XX商品交易所黄大豆2号交割质量标准(F/DCE B003—2017)》”。

4.12 交割地点

交割地点 (Delivery Venue) 是指由期货交易所统一规定的进行实物交割的指定地点, 适用于商品期货合约。

交割地点的表述: 期货交易所指定交割仓库或交易场所规定的其他地点。以XX商品交易所菜籽期货合约为例, 交割地点为“交易所指定交割仓库”。

4.13 交割单位

交割单位 (Delivery Size) 是指在期货交易所进行实物交割或现金交割的标的物的最小单位, 也即最小交割单位。

交割单位的表述可分为两种情形:

- a) 单位数量+度量单位。以XX期货交易所锌期货合约为例, 交割单位为“25吨”。
- b) 单位数量+货币单位。以XX金融期货交易所国债期货合约为例, 交割单位为“面值100万元的国债”。

4.14 最低交易保证金

最低交易保证金（Minimum Trade Margin）是指会员在交易场所专用的结算账户中确保期货合约履行，并已被期货合约占用的最低数额保证金。

最低交易保证金的表述：期货合约价值+百分比数额。以XX商品交易所玻璃期货合约为例，最低交易保证金为“期货合约价值的6%”，即如果一手该期货合约的价值为1300元，则其最低交易保证金为 $1300 \times 6\% = 78$ （元）。

4.15 交割方式

交割方式（Settlement Method）是指期货合约到期时，按照期货交易场所的规则和程序，了结到期未平仓期货合约的方式，构成期货合约条款之一。交割方式分为两类，实物交割与现金交割。实物交割是指以标的物所有权转移方式进行的交割，主要用于商品期货；现金交割是指按结算价进行现金差价结算的交割方式，主要用于股票指数等金融期货。

交割方式的表述：“实物交割”或“现金交割”。

4.16 交易代码

交易代码（Contract Code）是指该期货品种的英文字母或拼音字母的缩写。

交易代码的表述：该期货品种的英文字母或拼音字母的缩写。以XX期货交易所燃料油期货合约为例，交易代码为：FU；又以XX商品交易所鸡蛋期货合约为例，交易代码为：JD。

4.17 上市交易场所

上市交易场所（Exchange）是指该期货合约上市交易的期货交易场所。

上市交易场所的表述：期货交易场所的全称。如：XX期货交易所。

参 考 文 献

- [1] 《期货交易管理条例》（2007年3月6日中华人民共和国国务院令第489号公布 根据2012年10月24日《国务院关于修改〈期货交易管理条例〉的决定》第一次修订 根据2013年7月18日《国务院关于废止和修改部分行政法规的决定》第二次修订 根据2016年2月6日《国务院关于修改部分行政法规的决定》第三次修订 根据2017年3月1日《国务院关于修改和废止部分行政法规的决定》第四次修订）
- [2] 《期货交易所管理办法》（中国证券监督管理委员会令（第42号）2007年4月9日发布，自2007年4月15日起施行 根据2017年12月7日中国证券监督管理委员会《关于修改〈证券登记结算管理办法〉等七部规章的决定》修改）
- [3] 《上海期货交易所阴极铜期货标准合约》、《上海期货交易所黄金期货标准合约》、《上海期货交易所燃料油标准合约》、《上海期货交易所电解镍期货标准合约》
- [4] 《郑州商品交易所强麦期货合约》、《郑州商品交易所白糖期货合约》、《郑州商品交易所玻璃期货合约》、《郑州商品交易所菜籽期货合约》
- [5] 《大连商品交易所玉米期货合约》、《大连商品交易所黄大豆2号期货合约》、《大连商品交易所鸡蛋期货合约》
- [6] 《中国金融期货交易所沪深300指数期货合约表》、《中国金融期货交易所10年期国债期货合约》
- [7] 《现代期货大辞典》 主编：刘迎秋 人民出版社 1996年11月第1版
- [8] 《期货市场教程》 中国期货业协会编 中国财政经济出版社 2012年3月第7版（第二次修订）
-



中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0182—2020

轻量级实时 STEP 消息传输协议

Light weight realtime STEP message transfer protocol

2020-02-26 发布

2020-02-26 实施

中国证券监督管理委员会 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 会话机制.....	1
4.1 关键概念的重要说明.....	1
4.2 会话管理.....	5
4.3 恢复.....	6
5 消息规范.....	6
5.1 消息结构.....	7
5.2 管理消息.....	8
6 数据字典.....	14
6.1 数据类型.....	14
6.2 会话层域规范.....	15
附录 A （规范性附录）计算校验和.....	17
附录 B （规范性附录）处理心跳和测试请求.....	18
附录 C （规范性附录）登录场景.....	19
C.1 正常登录场景一.....	19
C.2 正常登录场景二.....	20
C.3 正常登录场景三.....	20
C.4 异常登录场景一.....	22
C.5 异常登录场景二.....	22
附录 D （规范性附录）处理会话拒绝.....	24
附录 E （规范性附录）处理重传请求场景.....	25
E.1 处理重传请求场景一.....	25
E.2 处理重传请求场景二.....	26
附录 F （规范性附录）注销场景.....	27

前 言

本标准依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本标准由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本标准由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本标准起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、上海证券交易所、深圳证券交易所、中证信息技术服务有限责任公司。

本标准主要起草人：姚前、刘铁斌、周云晖、杜娟、朱立、王鹏飞、李向东。

引 言

FIX (Financial Information eXchange) 协议即金融信息交换协议, 是用于全球金融市场机构和参与者间的电子金融信息交互的协议, 以下简称FIX协议。

在FIX标准化组织(FIX Trading Community)提出的FIX 5.0标准中, 单独定义有一个会话层协议(FIX Session Protocol, FIXT), 其版本是FIXT 1.1。JR/T 0022-2014《证券交易数据交换协议》(Securities Trading Exchange Protocol, 简称STEP)是FIX协议的行业标准。本标准是对FIXT 1.1及JR/T 0022-2014中会话层协议的轻量化。

轻量级实时 STEP 消息传输协议

1 范围

本标准规定了轻量级实时STEP消息传输协议（Light-weight realtime STEP message transfer protocol）使用的会话机制、消息格式、安全与加密、数据完整性、扩展方式、消息格式规范、数据字典等内容。

本标准适用于支持证券交易所与市场参与者和相关金融机构间的业务数据交换。本标准也可被推广用于支持证券期货行业各机构系统间的会话连接。

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，仅所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。

JR/T 0022—2014 证券交易数据交换协议

ISO 10383:2012 证券及相关金融工具 交易所和市场识别码（Securities and related financial instruments-Codes for exchanges and market identification(MIC)）

Financial information exchange protocol(FIX) Version 5.0 Service Pack 2, August 2011

Financial information exchange protocol(FIX) FIX session protocol version1.1, March 2008

3 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

3.1

证券交易数据交换协议 securities trading exchange protocol;STEP

证券交易所交易系统与市场参与者系统之间进行证券交易数据交换的行业信息标准。

3.2

金融信息交换协议 financial information exchange;FIX

进行证券交易信息电子交换的国际信息标准。

3.3

FIX会话层协议 fix session layer protocol;FIXT

独立于通信协议（如TCP、UDP等）和通信介质（如光缆、卫星等）的电子数据传输协议，FIX协议的重要子协议。

4 会话机制

4.1 关键概念的重要说明

4.1.1 会话层重传

4.1.1.1 本标准给出了市场参与者内部系统通过开放接口与证券交易所间的会话层连接标准。本标准是 FIX 标准化组织的 FIXT 1.1 标准的精简版，且消息标签的使用遵循 FIX 5.0 SP2 的规定。由于 JR/T 0022-2014 证券交易数据交换协议只是 FIX 协议的本地化版本，为凸显标准的直接来源，以下简称本标准为“LFIXT”。

4.1.1.2 如无特别说明，本标准中提及的接收方、发送方等通信参与方均特指遵循本标准而实现的应用程序或模块，以下简称为“LFIXT 参与方”。基于 FIXT 开发的程序或模块（以下简称为“FIXT 参与方”），若要和 LFIXT 参与方进行通信，也需遵循本标准的约束。

4.1.1.3 会话层重传是会话层协议所规定的一种重传机制，用来确保有序、无失地传输每一条会话层消息。在 FIXT 会话层协议中，会话层重传由消息接收方在识别出消息序号缺口之际主动发起，采取的方式是给对方发送一条消息重传请求。本标准在事实上取消了 FIXT 会话层协议的会话层重传，只对外仍然表现为标准的 FIXT 会话层，且可以和对端的 FIXT 参与方进行互操作。由于单个 LFIXT 会话使用单个 TCP 连接作为底层通信机制，因此在单个 TCP 连接内部，每一条消息将被有序、无失地传输。属于同一会话的、前后相继的若干次 TCP 连接之间，虽然可能存在会话层消息丢失，但收到的会话层消息将仍然具有有序接收的性质。由于在 LFIXT 标准下会话层可能存在消息丢失，因此丢失的业务消息将只能通过应用层重传予以恢复。

4.1.1.4 和 FIXT 协议一样，LFIXT 协议本身并不限定所用的标准端口号。作为基于 TCP 的会话层协议，LFIXT 使用的端口号建议在区间[1024, 49151]内，具体取值由通信双方事先另行约定。

4.1.2 应用层重传

由于本标准的会话层恢复机制仅仅是为了与 FIXT 会话协议兼容，不能作为真正的消息恢复机制使用。因此，应通过应用层商定的重传机制予以恢复。应用层重传的具体机制不属于本标准规定的范畴。

4.1.3 NxtIn 和 NxtOut

会话双方收发的每条消息都带有一个消息序号。参与通信的每一端都需要维护一对序号（NxtIn，NxtOut），NxtIn 表示下一个期望的入向消息序号，NxtOut 表示下一条出向消息将被赋予的序号。

4.1.4 会话发起方和接受方

4.1.4.1 会话的建立需要一个发起方，需要一个接受方。发起方是先发出 Logon 消息并希望对方响应以一个 Logon 消息的一方，接受方则是等待发起方首先发出 Logon 消息并响应以 Logon 消息的一方。会话的发起方和接受方在会话建立后都可以双向地进行消息的发送和接收。不要将会话发起方（initiator）、会话接受方（acceptor）同某条特定消息的发送方（sender）和接收方（receiver）混为一谈。

4.1.4.2 类似于会话发起方和会话接受方，也定义有注销发起方和注销接受方、会话重置发起方和会话重置接受方的概念。

4.1.4.3 FIXT 协议适用于各种不同的传输层协议（如 UDP），因此不可能根据 TCP socket 等特定的传输层信息来区分哪些报文属于同一个 FIXT 会话，而且由于 FIXT 中并不为每个 FIXT 会话定义有所谓“会话号”标签，且不是全部报文都具有 username 一类的标签，因此区分 FIXT 会话的唯一标识符是 SenderCompID 和 TargetCompID 字段的组合。LFIXT 标准作为 FIXT 标准的精简版，也遵循此要求。

4.1.4.4 FIXT 协议中，单个 FIXT 参与方不能同时保有具有相同 SenderCompID+TargetCompID 的两个会话。在 FIXT 中推荐的做法是：在已存在一个合法会话时，若一方试图以同样的 SenderCompID+TargetCompID 发起新的会话，对方将不发送任何 Logout 消息就直接终止新发起的会话，原先已存在的会话不应受到影响。另一方面，FIXT 协议并未明确不同的 FIXT 参与方是否允许同时保有同样标识的会话。一般而言，同一台服务器上的同标识会话较易进行查重，针对不同服务器建立的同标识会话则较难实现查重，但也非无法做到。在处理入向登录报文时，应利用 SenderCompID 和 TargetCompID 进行会话查重，之前已存在的同标识会话一定不受影响，但较晚收到的同标识会话请求可能被接受，但也可能被拒绝，FIXT 协议不作限定。若请求被拒绝，则拒绝方式将遵循 FIXT 协议的约定，不回送 Logout 消息，直接断开 TCP 连接。会话发起方应当对这种情形做好准备。LFIXT 标准作为 FIXT 标准的精简版，也遵循此要求。

4.1.4.5 本标准只允许单个会话同时通过单个 TCP 连接进行全双工通信，因此在通过登录报文信息确定是否允许继续通信后，可以直接利用 socket 来区分报文所属会话，但对于从同一 socket 上收到的后续报文仍应检查其 SenderCompID 和 TargetCompID 是否和登录时一致。

4.1.5 消息序号

所有的消息都由一个唯一的会话层消息序号(即消息头中的MsgSeqNum字段)进行标识。消息序号在会话开始时在大多数情况下被初始化为1，并在整个会话过程中连续递增，直到该会话过程全部结束。通过监视消息序号的连续性，通信双方可以识别消息缺口并做出反应，并可在同一会话的前后多个连接间进行同步。

上述的“连续递增”是针对通常情况而言。在下述情况下，接收方收到的消息的MsgSeqNum也可能出现倒流，但此时的倒流并非异常，而是被称为“正常倒流”：

- a) 收到的消息是 SeqReset-Reset 消息且 PossDupFlag=Y，此时应忽略 MsgSeqNum，即使出现倒流也不是错误；
- b) 收到消息的 PossDupFlag 是 Y，且此类消息确实允许出现 PossDupFlag=Y，表示这是会话层重传；
- c) 通过 Logon 消息进行会话序号重置时，收到的消息其 MsgSeqNum 一定是 1，因此也可能出现倒流。

每次会话都会创建一套独立的入向及出向的序号序列，参与连接的任何一方都维护一套用于出向消息的序号序列(NxtOut)，同时也维护另一套独立的入向消息的序号序列(NxtIn)，用以监视接收的消息序号，以保证消息缺口的发现和处理。

会话建立后，当LFIXT协议实现者接收到的消息序号不等于预期接收的消息序号(NxtIn)时，需要考虑进行修正处理。这里有几种情况：

- a) 如果入向消息序号<NxtIn，且不属于正常倒流，表明发生了严重的错误，应立即结束会话，并开始进行人工干预；
- b) 如果入向消息序号<NxtIn，且属于正常倒流，则不属于错误，应进行正常处理；
- c) 如果入向消息序号>NxtIn，那么表明有消息被遗漏。因为 LFIXT 使用 TCP 为传输协议，出现这种情况说明发生了严重异常错误，应立刻终止当前会话。

4.1.6 心跳

在消息交换的空闲期间，连接双方将以规定的时间间隔产生心跳消息。通过心跳消息可以监控通讯连接的状态并识别出入向消息序号的缺口。

心跳间隔时间由会话发起人通过登录消息的HeartBtInt字段确定。在传送了任何消息(而不仅仅是心跳消息)之后,都应立即重置心跳间隔计时器。心跳间隔时间应该得到连接双方的确认,由会话发起人给出,并得到会话接受方的确认。

连接双方应使用相同的心跳间隔时间。每个心跳消息都将占用一个MsgSeqNum消息序号。

4.1.7 有序消息处理

本标准采用TCP连接作为底层通信机制。在会话建立后,在同一个TCP连接的延续期间,接收方在发现入向消息缺口时,说明检测到了对方或通信连接发生了严重异常,建议接收方终止该会话并断开TCP连接。如果接收方为会话的发起方,则应根据需要重建会话。

4.1.8 可能的消息重复传送

本会话协议采用TCP连接作为底层通信机制,会话双方在建立TCP连接之后,通过Logon消息进行序号协商,其后则是基于TCP进行的连续通信,正常情况下,不应该出现前面消息丢失却收到后面消息的情形,所以:

- a) 在发现入向消息序号缺口时, LFIXT 参与者不应发送重传请求,应回送 Logout 后直接断开连接;
- b) 允许在入向消息中出现重传请求,比如基于 FIXT 的通信对手方虽然收到前面的消息但其自己没保存,并期望能按 FIXT 会话层协议的方式通过重传请求取回,对此 LFIXT 参与者将简单回送 SeqReset-Reset 消息予以回应;
- c) 允许在入向消息中出现 PossDupFlag=Y 的消息,比如基于 FIXT 的通信对手方虽未收到本方发出的重传请求,但仅仅因为怀疑本方可能错过某些消息,而向本方发送这类 PossDupFlag=Y 的消息。

根据FIXT标准,除了Reject消息之外,其他管理消息理论上都不应被重发,而是通过发送带有同样消息序号的、带有PossDupFlag标志的SeqReset-GapFill消息对原消息进行替代。在此过程中,被替代的SeqReset-GapFill消息本身虽然仍然以同样的消息序号、带上同样被置位的PossDupFlag标志出现,也被FIXT标准解释为“替代”而非“重发”。

4.1.9 可能的消息重复发送

在本标准中,应用层重发的标志应在应用层协议中明确设置,而不应该体现在会话层消息的标志位上。由于互操作的对方应遵从同样的应用层协议,因此本标准将不会给出向消息打上任何PossibleResend标志。

本标准允许在入向消息头中出现PossibleResend标志,但将忽略该标志,直接将不附带该标志的消息交由应用层处理。

4.1.10 消息完整性

消息数据内容的完整性可以用两种方式来验证:验证消息长度及字符的简单校验和。

消息长度被包括在BodyLength字段中,可以通过清点消息之中跟在BodyLength字段之后、直至并包括直接先于Checksum域号(‘10=’)出现的那个域界定符<SOH>之间的字符来验证。

校验和的验证方法是:从消息头中‘8=’中的‘8’开始、直到并包括直接先于Checksum域号‘10=’出现的<SOH>字符,将每个字符的二进制值加总后,将计算值的最低8位同Checksum字段中的值进行比较。

4.1.11 混乱的消息

当至少出现以下情形之一时,一条消息被称为“混乱的”:

- a) BeginString(tag8)不是消息的第一个标签，或不以 8=FIXT.n.m 的形式出现；
- b) BodyLength(tag9)不是消息的第二个标签，或未包含正确的字节计数；
- c) MsgType(tag35)不是消息的第三个标签；
- d) CheckSum(tag10)不是最后的标签，或其取值不正确；
- e) 若 MsgSeqNum(tag34)缺失，表明出现了严重的应用错误，应立刻终止 FIX 连接。

4.1.12 消息确认

由于本标准是基于乐观的消息传输模式，通过监视消息序号发现缺口，不支持对每个消息收发的确认。但大量消息收发的确认可在应用层定义，并在应用层接受或拒绝。

4.1.13 加密

LFIXT会话层不对数据进行加密处理，会话双方可考虑使用通信层的加密机制，比如使用建构于TCP之上的TLS通信加密机制。

4.2 会话管理

4.2.1 会话和连接

本标准采用TCP连接作为底层通信机制。

若LFIXT参与方作为会话的主动发起方，应在每次新建TCP连接之后通过置位序号重设标志（ResetSeqNumFlag）的Logon消息来将起始消息序号重置回1，此时会话和TCP连接是一一对应的。

虽然本标准可以被设计成底层使用两个独立的TCP连接，每个连接都以单工模式工作，但由于在TCP连接上实现全双工的通信并不困难且维护简单，因此本标准规定：对于单个会话而言，同时只使用一个全双工的TCP连接。

若LFIXT参与方作为会话的接收方，由于该会话的发起方可能是标准的FIXT，此时建立的会话可以跨越多个TCP连接。

在单次TCP连接内部，每个会话都分为三个部分：建立会话、消息交换、终止会话。

4.2.2 建立会话

4.2.2.1 会话步骤

建立会话包含三个内部步骤：建立连接、身份认证、消息同步。

4.2.2.2 建立连接

会话的发起方与接受方应先建立 TCP 连接。LFIXT 参与方在 TCP 连接建立后，应当总是初始化 NxtIn=1, NxtOut=1。

4.2.2.3 身份认证

会话发起方发送登录消息（Logon），会话接受方认证发起方身份的合法性。处理逻辑如下：

- a) 如果发起方身份通过认证，则接受方发送一个登录消息作回应。
- b) 如果认证失败，会话接受方则在可选地发送一个含失败说明的注销消息（Logout）后关闭连接。发送注销消息并非必须是必须的，因为这样做会消耗一个序号，在某些情况下可能会引起其他问题。
- c) 会话发起方应等待来自接受方的确认 Logon 消息，方可向接受方发送其他消息。否则，接受方可能尚未准备好接收它们。

- d) 在发起方被认证后,接受方将立即回应一个确认 Logon 消息。发起方将把从接受方返回的 Logon 消息作为“一个会话已经建立”的确认。

4.2.2.4 消息同步

本标准并不提供真正的会话层重传机制,因此LFIXT参与方作为会话的发起方时,可通过会话重置消息(即ResetSeqNumFlag=Y的Logon消息)将会话双方的消息序号重置,来完成会话层消息同步。

LFIXT参与方作为会话接受方时,可以利用Logon消息中的NextExpectedMsgSeqNum来完成会话层消息同步。这种方式提供了对FIXT会话协议的消息同步的兼容,具体机制见4.3.2登录消息处理。

4.2.3 消息交换

在建立会话之后,会话双方可以开始进行正常的消息交换。交换的消息包括“管理消息”和“应用消息”,本标准仅对管理消息进行描述。

4.2.4 注销会话

LFIXT会话的正常结束是通过连接双方互相发送注销消息(Logout),注销时不需要进行消息缺口检查。若结束时没有收到回送的注销消息(Logout),则把对方视作已注销。除此之外的其它方式的会话结束视为非正常,并按错误来处理。

在结束会话之前,注销消息(Logout)的发起方应等待对方回送的注销消息(Logout)。如果接收方在一定时间内没有答复,那么会话就可以立即中断。注销不影响任何业务层消息的状态。所有有效的业务层消息都可在注销(Logout)之后执行。

4.3 恢复

4.3.1 会话恢复机制概述

本标准的会话层恢复机制是为了与FIXT会话协议兼容,不能作为真正的消息恢复机制使用,会话对端应通过应用层的消息恢复机制来获得缺失的数据。

LFIXT参与方只在建立会话阶段存在消息序号同步,在会话持续期间不提供真正的消息恢复,而是简单地通过回应SeqReset-Reset消息来打发消息重传请求。

4.3.2 登录消息处理

LFIXT参与方作为会话接受方时,只需将本方NxtIn设置为发起方Logon消息的MsgSeqNum+1, NxtOut设置为发起方Logon消息中的NextExpectedMsgSeqNum(789)即可。会话接受方不需要检查任何缺口,会话接受方也不会向发起方请求重传任何消息。如果会话发起方没有提供NextExpectedMsgSeqNum字段,则会话接受方的NxtOut设置为1。

4.3.3 重传请求消息处理

LFIXT参与方不会主动发送重传请求,但可能收到FIXT参与方发送的重传请求。当LFIXT参与方收到重传请求时,会使用SeqReset-Reset消息重置发送方序号,而不会提供历史消息的重传。

4.3.4 序号重设消息处理

LFIXT参与方收到序号重设消息时,会根据序号重设消息中的NewSeqNo来重置本方NxtIn。

5 消息规范

5.1 消息结构

5.1.1 消息的组成部分

每一条消息都由消息头、消息体、消息尾组成。消息总是由标准消息头开始，标准消息尾结束。

5.1.2 消息头

会话双方所有交换的消息都具有标准的消息头，消息头所包含的各字段见表1所示。

每一个消息都由一个标准消息头开始。消息头规定了消息的类型、长度、目的地、顺序号、起始点和时间等数据域，均不进行会话层的加密传输。

其中有两个域用于消息重发。当作为会话级事件的结果而重复传送消息时，PossDupFlag被设置为Y，发送时沿用原来的消息序号；当应用层重新发送消息时，应使用新的消息序号，并通知会话层将PossResend设置为Y。接收者应按以下方法处理上述消息：

- a) PossDupFlag=Y：如果以前曾经收到过带有该消息序号的某条消息，则忽略本消息，如果不是，则按正常步骤处理。
- b) PossResend=Y：不附带本标志地将消息传递给应用层，由应用层根据业务逻辑自行确定此前是否收到该消息。

表 1 消息头字段

Tag	域名	必选	字段描述
8	BeginString	Y	起始串 FIXT.1.1 (总是不在会话层进行加密，应是消息的第一个域)。
9	BodyLength	Y	消息体长度 (总是不在会话层进行加密，应是消息的第二个域)。
35	MsgType	Y	消息类型 (总是不在会话层进行加密，应是消息的第三个域)。
49	SenderCompID	Y	发送方公司号。发送方不一定真是一个公司，因此应理解为发送方代码字符串 (总是不在会话层进行加密)。由通信双方事先协商确定。
56	TargetCompID	Y	接收方公司号。接收方不一定真是一个公司，因此应理解为接收方代码字符串 (总是不在会话层进行加密)。由通信双方事先协商确定。
34	MsgSeqNum	Y	消息序号，整数类型。
43	PossDupFlag	N	会话层可能重传标志；会话层重复传送时，作此标记。
97	PossResend	N	应用层可能重发标志。 LFIXT 会话层协议的实现者不应在出向消息中主动设置本字段，对于入向消息中出现的本字段将简单忽略。
52	SendingTime	Y	发送时间，UTCTimestamp 类型。
347	MessageEncoding	N	消息中编码域的字符编码类型。

5.1.3 消息尾

会话双方所有交换的消息具有见表2所示标准的消息尾。每一个消息（管理或应用消息）都用一个消息尾终止。消息尾可用于分隔多个消息，包含有3位数的校验和值。其字段说明见表2。

表 2 消息尾字段

Tag	域名	必选	字段描述
10	Checksum	Y	校验和，总是消息的最末域，总是不在会话层进行加密。

Checksum计算方法对应的C语言代码参见附录A。

5.2 管理消息

5.2.1 管理消息和两种模式的关系

本标准支持FIXT的所有管理消息，但不会主动发送所有管理消息。

本标准分两种模式：精简模式和兼容模式，各自有不同的使用范围。

已知通信对手方为LFIXT参与者时，可以采用精简模式，此时只需要支持见表3所示消息的接收和发送处理。此时由于本方不会主动发送ResendRequest，因此根据协议也不会触发对方回应SeqReset-Reset，因此不需要处理入向的SeqReset-Reset消息。

表 3 精简模式：仅和 LFIXT 参与者通信时

管理消息类型	来自对方	本方发送
Heartbeat	是	是
Logon	是	是
Reject	是	是
Logout	是	是

当需要和基于FIXT的对手方进行通信时，应采用兼容模式。此时本标准实现者需要支持所有管理消息的接收，见表4所示，但仍然不需要支持所有管理消息的发送。兼容模式和精简模式主要的区别只在于前者需要处理更多的入向管理消息。

表 4 兼容模式：和 FIXT 参与者通信时

管理消息类型	来自对方	本方发送
Heartbeat	是	是
Logon	是	是
TestRequest	是	否
ResendRequest	是	否
Reject	是	是
SeqReset-Reset	是	是
SeqReset-GapFill	是	否
Logout	是	是

例如，交易所端的LFIXT参与者应采用兼容模式以取得最大程度的协议兼容性。在已知交易所端采用兼容模式LFIXT协议的前提下，券商端可以选用精简模式的LFIXT协议，从而用最小的代价实现交易所接入，也可以考虑采用兼容模式甚至是基于FIXT完成交易所接入。

精简模式的LFIXT协议实现简便，但不具备和FIXT协议互通的能力，使用者应全面衡量各系统的总体成本以确定实际使用的协议。不同协议实现者之间的兼容情况见表5。

表 5 协议兼容性矩阵

	FIXT	兼容模式 LFIXT	精简模式 LFIXT
FIXT	√	√	×
兼容模式 LFIXT		√	√
精简模式 LFIXT			√

5.2.2 Heartbeat 心跳消息 (MsgType=0)

会话双方都可借助Heartbeat消息来检测当前使用的TCP连接的状态,因此当任何一方处于数据发送空闲期时,都需要定时发送Heartbeat消息以供检测链接的健康度,故会话双方都应支持心跳信号的主动发送,心跳消息字段见表6所示。接收方如果在两倍的([HeartBtInt]+[合理传输时间])内没有收到来自对方的心跳消息,就认为连接失败,此时可以不发送Logout消息,立即关闭TCP连接。

本标准不会主动发送TestRequest消息,但LFIXT参与方,为了与FIXT会话协议的兼容,如果收到了TestRequest请求,应按FIXT会话协议向发送方返回心跳响应。

如果上层应用约定有应用层心跳信息,并以不低于HeartBtInt的间隔主动发送,则在事实上使得会话层心跳消息的发送条件永远得不到满足。在这种情况下,一方即使只收到应用层心跳消息,永远也无法收到来自对方的会话层心跳消息,也不违反本标准。

附录B给出了帮助理解心跳和测试请求消息的例子。

表 6 心跳消息字段

Tag	域名	必选	字段描述
	StandardHeader	Y	MsgType=0
112	TestReqID	N	字符串。如是对 TestRequest 响应而发送的心跳消息,则应包含本域。本域的内容直接来自于触发本心跳消息的 TestRequest 消息的内容。
	StandardTrailer	Y	

5.2.3 Logon 登录消息 (MsgType=A)

登录消息应是请求建立一个会话的应用所发送的第一个消息,其消息格式规范见表7所示。

HeartBtInt(108)域用来声明产生心跳的超时间隔(连接双方使用相同的值)。LFIXT协议遵照FIXT协议的做法,本身不规定本字段的取值。连接双方事先约定取值,由登录发起方产生,并得到登录接受方的确认响应。

当收到登录消息时,会话接受方将验证发起方身份的合法性,并且发出登录消息作为连接请求已被接受的确认。同样,确认的登录消息也可以被发起方用以验证连接是与正确的对方建立的。

会话接受方应在收到登录消息之后,立即作好开始消息处理的准备。

本标准规定:应在收到返回的登录消息之后才实施正常的消息交换。

LFIXT参与方若作为会话发起方,其发送的Logon消息应将MsgSeqNum设置为1、ResetSeqNumFlag设置为Y、NextExpectedMsgSeqNum设置为1。

FIXT参与方若要向LFIXT参与方发起会话,且选择采用NextExpectedMsgSeqNum(789)来实现序号同步,应在Logon消息中将该字段填写为FIXT参与方已保存的入向消息的最大序号+1。比如FIXT参与方保存了入向消息1-7,没有保存入向消息8和9,但保存了入向消息10,此时应该填写此字段为11,而非8。这一点在FIXT协议中并未明确规定,故本标准对此予以特别限定。

表 7 Logon 登录消息字段

Tag	域名	必选	字段描述
	StandardHeader	Y	MsgType=A
98	EncryptMethod	Y	加密方法 始终为 0，即不加密。
108	HeartBtInt	Y	心跳间隔，单位是秒。双方应用同一个值。
141	ResetSeqNumFlag	N	双方序号重设回 1 的标志，布尔型。
789	NextExpectedMsgSeqNum	N	接收方期望得到的下一条消息序号，可选。若不填写，认为取值为 1。
553	Username	N	用户名
554	Password	N	密码
1137	DefaultApplVerID	Y	本次会话中使用的 FIX 消息的缺省版本。
1407	DefaultApplExtID	N	本次会话中，FIX 消息的缺省自定义应用版本。本标签是对 tag1137+tag1407 的进一步约束。
1408	DefaultCstmApplVerID	N	本字段填写数据协议版本，建议的格式是：STEP 版本号_市场代码_市场内部唯一的协议版本号。
	StandardTrailer	Y	

附录C给出了若干帮助理解正常登录、异常登录场景的例子。

5.2.4 TestRequest 测试请求消息 (MsgType=1)

测试请求消息能强制对方发出心跳消息，其消息格式规范见表8所示。会话协议不会主动发送该消息。测试请求消息的作用是检查对方消息序号和检查通信线路的状况。对方用带有测试请求标识符 (TestReqID) 的心跳作应答。LFIXT参与方不会主动发送任何TestRequest消息。

表 8 测试请求消息

Tag	域名	必选	注释
	StandardHeader	Y	MsgType=1
112	TestReqID	N	测试请求标识符
	StandardTrailer	Y	

5.2.5 Resend 重发请求消息 (MsgType=2)

重发请求消息由接收方发出，消息格式规范见表9所示，目的是向发送方申请某些消息重复发送。本标准不会主动发送该消息。

重发请求消息有以下三种表示方式：

- 请求重发一条消息：BeginSeqNo=EndSeqNo；
- 请求重发某个范围内的消息：BeginSeqNo=该范围中的第 1 条消息序号，EndSeqNo=该范围中的最后一条消息序号。注意请求重发一条消息只是本形式的特例；
- 请求重发某一特定消息之后的所有的消息：BeginSeqNo=该范围中的第 1 条消息，EndSeqNo=0（代表无穷大）。

LFIXT参与方作为本消息的接收方时，只会通过SeqReset-Reset消息响应FIXT参与方发送的重传请求消息。

表 9 Resend 重发请求消息

Tag	域名	必选	注释
	StandardHeader	Y	MsgType=2
7	BeginSeqNo	Y	起始消息序号
16	EndSeqNo	Y	结束消息序号
	StandardTrailer	Y	

5.2.6 Reject 会话拒绝消息 (MsgType=3)

当接收方收到一条消息，由于违反了会话层规则而不能适当地处理该消息时，应发出Reject（拒绝）消息，拒绝消息的消息格式见表10所示，会话拒绝原因见表11所示。发出Reject消息可能是合适的一个例子是：收到了一条成功经过解码、校验和检查及BodyLength检查的消息，但该消息带有不合法的基本数据（比如：MsgType=&）。

只要可能，消息应尽可能被转发给交易程序并通过业务层拒绝（而非会话层的Reject消息）来响应。若收到一条满足会话层规则的应用层消息，它应在业务消息的层面被处理。若此处理过程发现了规则的违反，则应当产生一条业务层拒绝消息。许多业务层消息有特有的“拒绝”消息，应该使用这些消息。全部其他情况都可以通过“业务消息拒绝消息”进行拒绝。注意，即使收到了业务消息，且满足会话层规则，但当此消息不能被送达业务层处理系统的时候，也应发送一条BusinessRejectReason=“应用此刻不存在”的“业务消息拒绝”消息。

被拒绝的消息应该被记录日志，且入向序号应该增加。

和FIXT会话协议不同之处在于：在本标准中，如果收到的消息是混乱的(garbled)，或者说：不能被解析或不能通过数据完整性检查时，应当记录日志后回送Logout消息并立刻断开连接（在FIXT会话协议中建议忽略并丢弃本消息，以期望后续收到的正确格式的消息能触发一个消息缺口，从而能通过重传请求再度拿回这条混乱的消息）。同时也需要注意：这并非会话层Reject消息的使用场景。

产生和收到Reject消息，意味着出现了严重错误，可能发送方或接收方的应用存在逻辑错误。

如果发送方应用选择重新发送被拒绝的消息，应当使用新的消息序号并设置PossResend=Y。因为PossResend=Y的语义是可能的应用层重发，因此这里被重新发送的一定是指应用层消息而非管理消息。

建议在本消息的Text字段中描述引起错误的原因。

当收到Reject消息本身时，建议记录日志，然后调整入向序号。

附录D给出了会话拒绝场景的例子。

表 10 Reject 消息

Tag	域名	必选	说明
	StandardHeader	Y	MsgType=3
45	RefSeqNum	Y	关联消息的序号，即被拒绝消息(对方发送且己方收到)的序号。
371	RefTagID	N	相关错误消息中，出现错误的FIX域号。
372	RefMsgType	N	相关错误消息的MsgType
373	SessionRejectReason	N	会话拒绝原因编号
58	Text	N	文本，可解释拒绝的原因。
	StandardTrailer	Y	

表 11 会话拒绝原因

会话拒绝原因(SessionRejectReason)
0=无效域号
1=该消息中必选的域丢失
2=该消息中出现未曾定义的域
3=未定义的域号
4=声明了域，但未赋值
5=此域的值错误（范围溢出）
6=取值格式错误
7=解密错误
8=签名错误
9=CompID 错误
10=发送时间精度错误
11=无效的 MsgType
12=XML 验证错误
13=域多次出现（非重复组）
14=有序的域出现次序错误
15=重复组中，域次序错误
16=重复组中，NumInGroup 错误
17=非 data 数据域中，出现域界定符<SOH>
99=其他。注意可能存在其他的会话层规则违反，此时，“会话拒绝原因” 99 可以被使用，进一步的信息应当包括在 Text 字段中。

5.2.7 SeqReset 序号重设消息（MsgType=4）

序号重设消息由发送方发出，用于告知接收方下一个消息的消息序号，序号重设消息的消息格式规范见表12。序号重设消息有两种模式：序号重设-缺口填补（SeqReset-GapFill）；序号重设-重设（SeqReset-Reset）。

在本标准中，只使用SeqReset-Reset消息回应ResendRequest消息。ResendRequest消息所请求的消息范围不应和接收方当前NxtOut矛盾，即当EndSeqNo>0时，应保证BeginSeqNo<=EndSeqNo<NxtOut；当EndSeqNo=0时，应保证BeginSeqNo<NxtOut。此SeqReset-Reset消息的MsgSeqNum按FIXT协议规定可以任意填写且接收方不会检查，在LFIXT中规定固定填写1，其中的NewSeqNo则建议填写为本方当前NxtOut值，且作为NxtOut序号维护的特例，在发送完本SeqReset-Reset消息后发送者的NxtOut保持不变。序号重设只能增加消息序号。如果收到的序号重设消息试图使下一个预期的消息序号变小，那么此消息应被拒绝接受，并被视作为严重错误。

在本标准中，虽然不会主动发起重传请求，但仍然有可能收到FIXT参与方对手主动发出的SeqReset类消息。

当收到的序号重设消息为SeqReset-GapFill消息时，应确保NewSeqNo大于等于SeqReset-GapFill消息本身的MsgSeqNum+1且不允许NewSeqNo>NxtIn，此时本方NxtIn保持不变；否则，被视为严重错误。

当收到SeqReset-Reset消息时，则需要忽略MsgSeqNum的检查，同时令本方NxtIn=NewSeqNo。

附录E给出了若干帮助理解重传请求处理场景的例子。

表 12 序号重设消息

Tag	域名	必选	注释
	StandardHeader	Y	MsgType=4
123	GapFillFlag	N	缺口填补标志。布尔型。“Y”表明是 GapFill 模式；“N”或不存在本域，表明是 Reset 模式。
36	NewSeqNo	Y	新消息序号
	StandardTrailer	Y	

5.2.8 Logout 注销消息 (MsgType=5)

注销消息是发起或确认会话终止的消息，消息格式规范见表13。未经注销消息的交换而断开连接，一律视为非正常的断开。

在最后终止会话之前，注销的发起人应该在主动发送注销消息后等待连接对方确认注销消息。如果连接对方没有在适当的时间间隔里作回应，那么会话就可以终止。本标准遵照FIXT协议的做法，本身不规定退登超时时间间隔的取值，而是应由连接双方另行约定。

存在一种边界情况，也就是会话双方在差不多相同的时刻都在没有收到对方Logout消息的前提下独立向对方发出了Logout注销消息。因此，其中一方A可能刚主动发出Logout消息就收到了对方B的Logout消息，虽然B的这条消息并不是针对A主动发起的那条Logout消息的应答，但对于A而言他是无法也无须区分这两种情况的，A仍然可以认为退登握手已经正常完成。

注销发起人在发送注销消息之后不应发送任何消息，除非接收到连接对方发出的重传请求消息。

一般而言，作为注销发起方的通信对手方，在收到注销发起方发来的Logout消息后，在关闭连接前推荐的做法是回送一条Logout消息以利于对端诊断连接断开的原因。但此处可有一些例外：

- 若收到的登录报文中，SenderCompID, TargetCompID 或者会话发起方的 IP 地址不合法，推荐做法是会话立即终止，不发送任何 Logout 消息。原因是此种登录尝试很可能属于未被授权的系统入侵行为，因此不应回送 Logout 消息以泄露 FIXT 版本、合法 SenderCompID、TargetCompID 等信息；
- 在 FIXT 协议中，在收到登录请求时若在同一个 FIXT 若已存在一个合法的由相同 SenderCompID+TargetCompID 唯一标识的会话，则 FIXT 将直接断开后来的登录请求所欲发起的会话。

由于任何时刻都存在网络中断的可能，因此本标准的任何参与方都应对于未收到对方的Logout消息但底层TCP连接却已关闭的情况做好准备。在断开连接前回送Logout消息是推荐行为，但非必选。

对于收到报文中的各类异常，接收方通常处理的原则：

- TCP 通信异常/潜在的恶意攻击：推荐处理方式是直接断开 TCP 连接。由于在任何情况下通信参与者都应能够处理 TCP 连接的中断，因此这也是缺省处理办法。
在同一个 TCP 连接上，第一个收到的报文不是正确的 Logon 报文，或者在已经 Logon 成功的 TCP 连接上又收到一个普通的 Logon 消息，也视作恶意攻击，直接断开。
- 混乱的报文、入向消息序号出现缺口：推荐处理方式是回送 Logout 消息，然后断开 TCP 连接。
- 报文不混乱，但不满足会话层规则：推荐处理方式是发送 Reject 拒绝此消息，会话继续。
- 报文不混乱，满足会话层规则：交给应用层去处理。如果应用层发现报文违反了应用层规则，回送应用层拒绝消息，会话继续。

附录F给出了帮助理解正常注销场景的例子。

表 13 注销消息

Tag	域名	必选	字段描述
	StandardHeader	Y	MsgType=5
1409	SessionStatus	N	Logout 时的会话状态。根据 FIXT 协议有如下取值： 0=会话活跃 1=会话口令已更改 2=将过期的会话口令 3=新会话口令不符合规范 4=会话退登完成 5=不合法的用户名或口令 6=账户锁定 7=当前时间不允许登录 8=口令过期 9=收到的 MsgSeqNum(34) 太小 10=收到的 NextExpectedMsgSeqNum(789) 太大。 100 及 100 以上的数字可供用户在双边认可的情况下自定义
58	Text	N	文本。注销原因的进一步补充说明。
	StandardTrailer	Y	

6 数据字典

6.1 数据类型

本标准中使用的数据类型的说明及规范见表 14。

表 14 数据类型

数据类型	类型规范	说明
SeqNum	N18	消息序号 正整数
Boolean	C1	‘Y’ =Yes/True, ‘N’ =False/No
Length	N9	长度，表示字节为单位的数据长度，非负数。
UTCTimeStamp	C21	UTC 时间戳，注意，FIXT 协议允许使用 YYYYMMDD-HH:mm:ss, YYYY=0000-9999, MM=01-12, DD=01-31, HH=00-23, mm=00-59, SS=00-60（秒）， 或 YYYYMMDD-HH:mm:ss.sss(毫秒)， YYYY=0000-9999, MM=01-12, DD=01-31, HH=00-23, mm=00-59, SS=00-60（秒）， sss=000-999（毫秒） 之中的任何一种格式

表 14 数据类型（续）

数据类型	类型规范	说明
LocalTimeStamp	C21	本地时间戳 YYYYMMDD-HH:mm:ss. sss(毫秒), YYYY=0000-9999, MM=01-12, DD=01-31, HH=00-23, mm=00-59, SS=00-60 (秒), sss=000-999 (毫秒)
NumInGroup	N9	重复数 表示重复组的项数, 正数
注: 除非特别声明, 浮点数类型均有正负, 类型规范Nx(y)中, x表示整数与小数总计位数的最大值, 不包括小数点, y表示固定的小数位数。类型规范Cx中, x表示字符串的最大长度。		

6.2 会话层域规范

会话层域规范见表 15。

表 15 会话层域规范

Tag	域名	类型	说明
7	BeginSeqNo	SeqNum	起始消息序号
8	BeginString	C16	起始串 固定为 FIXT.1.1
9	BodyLength	Length	消息体长度
10	Checksum	C3	校验和 不在会话层加密, 应是最后一个域。 校验算法见附录 F
16	EndSeqNo	SeqNum	结束消息序号
34	MsgSeqNum	SeqNum	消息序号, 由 1 开始。
35	MsgType	C16	消息类型
36	NewSeqNo	SeqNum	新消息序号
43	PossDupFlag	Boolean	指示该消息序号的消息可能重复发送, 取值: =Y: 可能重复 =N: 首次发送
49	SenderCompID	C32	发送方公司号。发送方不一定真是一个公司, 因此应理解为发送方代码字符串(总是不加密)。由通信双方事先协商确定。
52	SendingTime	UTCTimestamp	消息发送时间, UTCTimestamp 类型。
56	TargetCompID	C32	接收方公司号。接收方不一定真是一个公司, 因此应理解为接收方代码字符串(总是不加密)。由通信双方事先协商确定。
58	Text	C1024	文本

表 15 会话层域规范（续）

Tag	域名	类型	说明
97	PossResend	Boolean	可能重发标志 指示该消息可能发送过（使用不同的消息序号），取值： =Y: 可能重发 =N: 首次发送
98	EncryptMethod	N8	加密方法 =0: 即不加密
108	HeartBtInt	N8	心跳监测的时间间隔 为系统设定值，以秒为单位。
112	TestReqID	C32	测试请求标识符
141	ResetSeqNumFlag	Boolean	序号重设标志
123	GapFillFlag	Boolean	缺口填补标志 用于序号重设消息，指示是否填补缺口，取值： =Y: 序号重设-缺口填补消息，消息序号域有效 =N: 或不存在序号重设-重设消息，消息序号域无效
347	MessageEncoding	C16	消息中编码域的字符编码类型
371	RefTagID	N9	相关错误消息中，出现错误的 FIX 域号。
372	RefMsgType	C16	相关错误消息的 MsgType
373	SessionRejectReason	N9	会话拒绝原因编号，无符号整数。
383	MaxMessageSize	Length	最大消息长度，单条消息的最大字节数。 该字段暂未启用
553	UserName	C32	用户名
554	Password	C32	密码
789	NextExpectedMsgSeqNum	SeqNum	接收方期望得到的下一条消息序号
1137	DefaultApplVerID	C8	本次会话中使用的 FIX 消息的缺省版本。若取值为'9'，意思是'FIX50SP2'。
1407	DefaultApplExtID	N8	本次会话中使用的 FIX 消息[在 Tag1137 基础上]的缺省扩展包。若取值'124'，意思是'EP124'。
1408	DefaultCstmApplVerID	C32	本次会话中，FIX 消息的缺省自定义应用版本。本标签是对 tag1137+tag1407 的进一步约束。 本字段填写数据协议版本，建议的格式是：STEP 版本号_市场代码_市场内部唯一的协议版本号。 本字段只需要对于会话双方而言本字段取值可供唯一地标识和区分数据协议版本，不需要全世界统一。为确保版本唯一性，建议市场代码填写 ISO 10383:2012 中定义的市场标识代码(MIC)。如果使用自定义市场代码，会话双方使用此类代码时需自行确保市场代码无歧义。
1409	SessionStatus	N4	本字段填写退登时的会话状态

附 录 A
(规范性附录)
计算校验和

以下为计算校验和的 C 语言代码段：

```
char*GenerateChecksum(char*buf,longbufLen)
{
    chartmpBuf[4];
    longidx;
    unsignedintcks;

    for(idx=0L,cks=0;idx<bufLen;cks+=(unsignedint)buf[idx++]);
    sprintf(tmpBuf,"%03d",(unsignedint)(cks%256));
    return(tmpBuf);
}
```

附录 B
(规范性附录)
处理心跳和测试请求

图 B.1 是心跳和测试请求的场景，连接双方的空闲持续在经过一个约定的时间间隔后，连接双方根据规则都可以发送心跳。FIXT 协议的实现者可以不受限制地主动发起测试请求。图 B.1 中的 Server 是 LFIXT 参与方，不会主动发起测试请求。

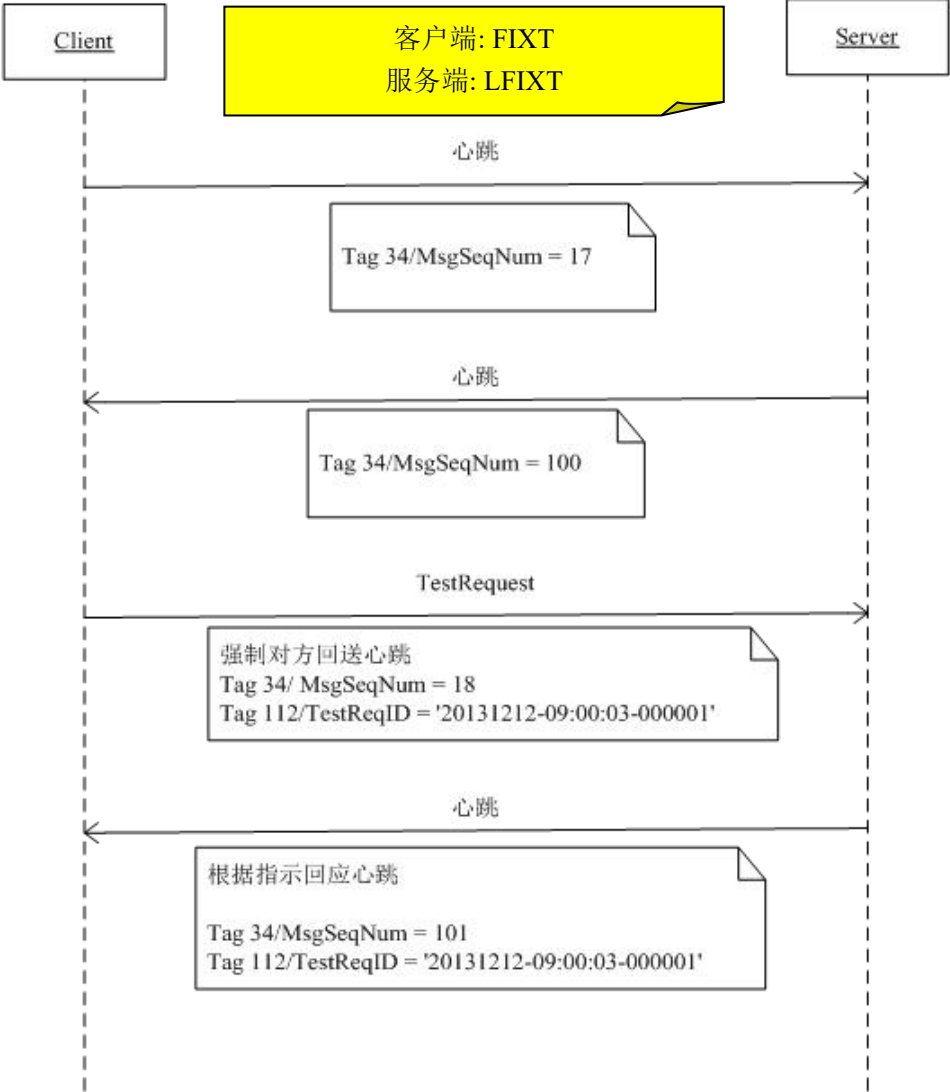


图 B.1 处理心跳和测试请求

附 录 C
(规范性附录)
登录场景

C.1 正常登录场景一

LFIXT参与方作为登录发起方——Client,LFIXT参与方作为登录接受方——Server,日间正常登录。
场景开始时,TCP连接刚建立时,Client的NxtOut=1, NxtIn=1, Server的NxtOut=1, NxtIn=1。场景流程图如图C. 1所示。

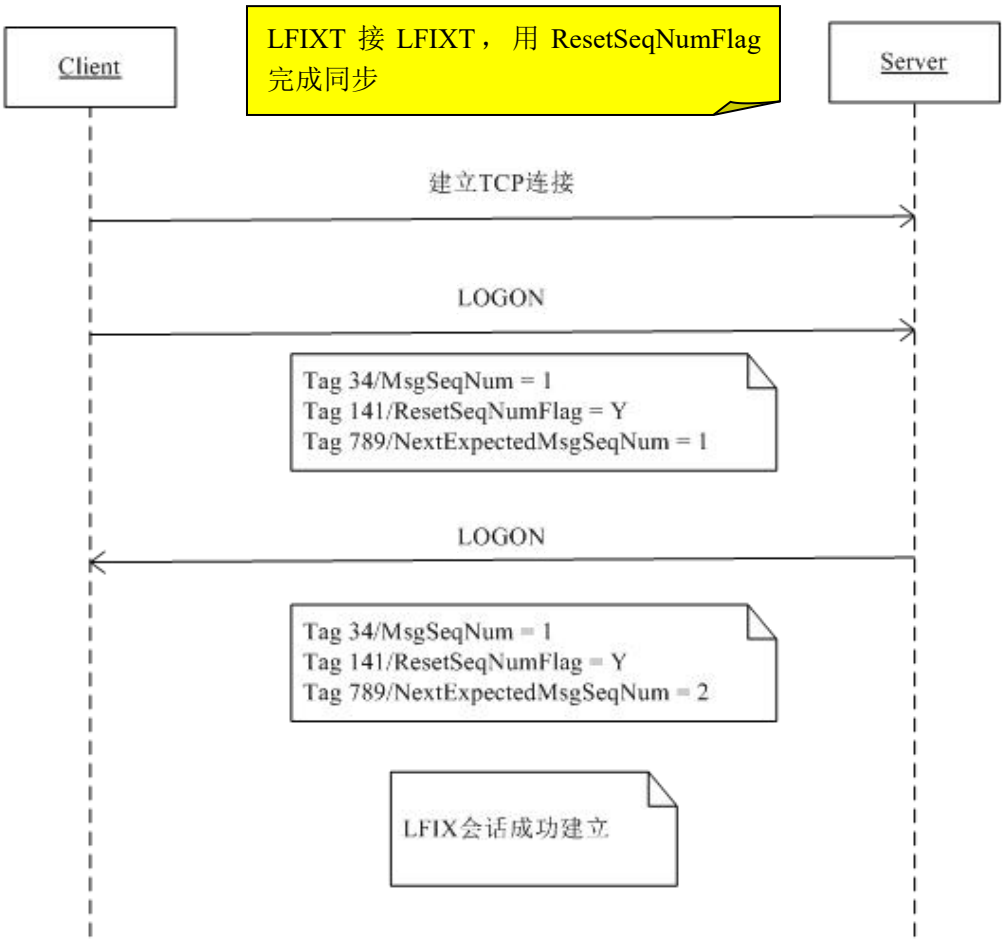


图 C.1 正常登录场景一

以图C. 1中显示的场景为例,在会话建立后,将Client的NxtOut=2, NxtIn=2, Server的NxtOut=2, NxtIn=2。

C.2 正常登录场景二

FIXT参与方作为登录发起方——Client，LFIXT参与方作为登录接受方——Server，日间非首次正常登录，且Client不设置ResetSeqNumFlag，设置NextExpectedMsgSeqNum为其在前一次连接断开时的NxtIn。

场景开始时，TCP连接刚建立后，Client的NxtOut=100，NxtIn=189，Server的NxtOut=1，NxtIn=1。在此之前，Server曾经向Client发送过MsgSeqNum为189，190的业务消息，但因为通信故障，Client没有收到，所以Client端保存的NxtIn仍然是189，而非191。

场景流程图如图C.2所示。

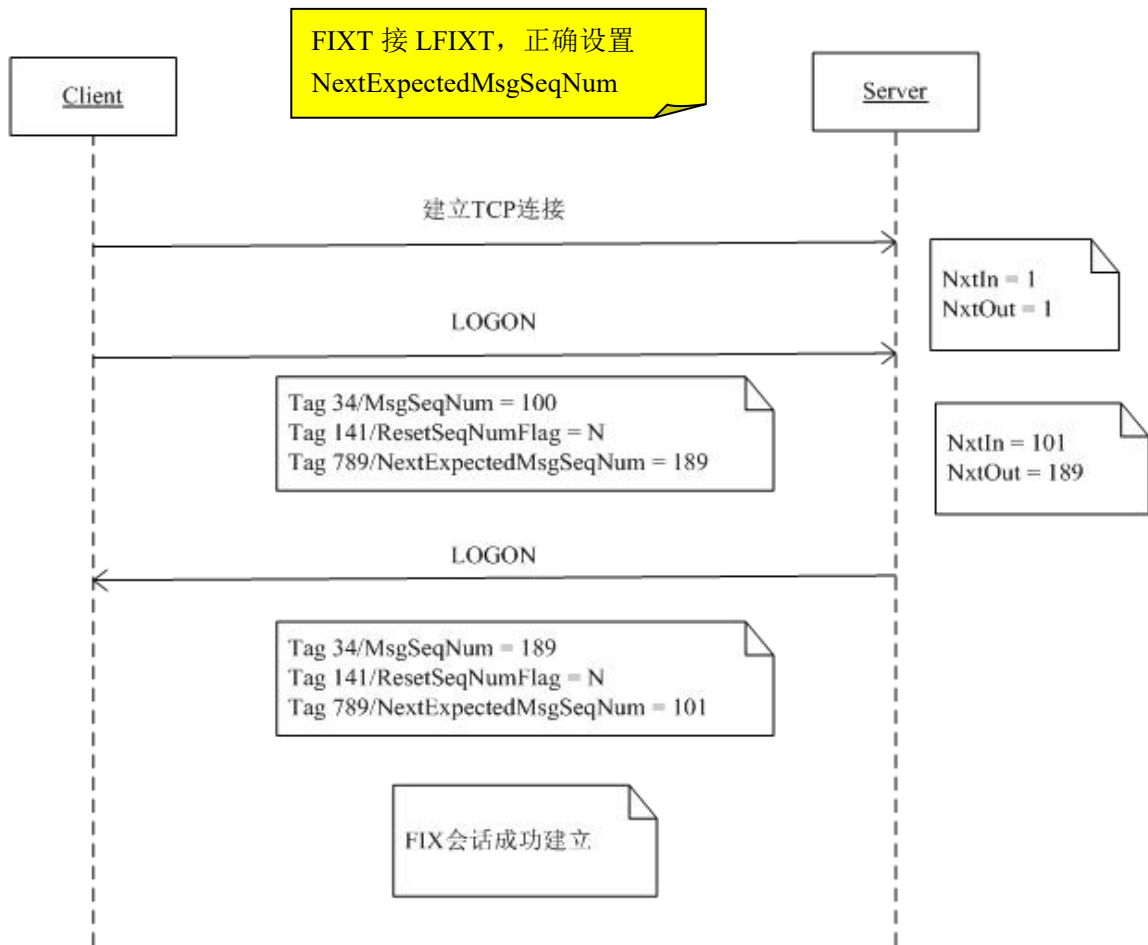


图 C.2 正常登录场景二

以图C.2中的场景为例，在会话建立后，Client的NxtOut=101，NxtIn=190，Server的NxtOut=190，NxtIn=101。注意两次TCP连接上Server发送给Client的MsgSeqNum=189的消息并不相同，但因为Client没有保存之前收到的MsgSeqNum=189的业务消息，所以第二次收到MsgSeqNum=189的Logon应答消息也不会发现存在不一致。

C.3 正常登录场景三

为了说明在FIXT协议中，NextExpectedMsgSeqNum相关的自动缺口填补的原理，撰写此场景。本场景中，通信双方都遵循FIXT协议。场景流程图如图C.3所示。

在场景开始的时候，Server的NxtOut是250，NxtIn是200；由于Server和Client之间出现了网络中断，因此Client只收到了序号为247（含）以前的来自Server的消息，其NxtOut是200，NxtIn是248。

Server收到的来自Client的登录消息中，NextExpectedMsgSeqNum是248，但Server端内部下一个发送的应该是LOGON消息，应使用新的序号250。但Server端也知道Client端出现了消息缺口，且根据协议Client不会为此缺口发送ResendRequest消息，而是需要Server端主动推送缺口部分的消息。因此Server端马上重复传送业务消息248，业务消息249，并用SeqReset-GapFill消息替代消息250——Logon消息，之后就可以开始正常传送业务消息251。

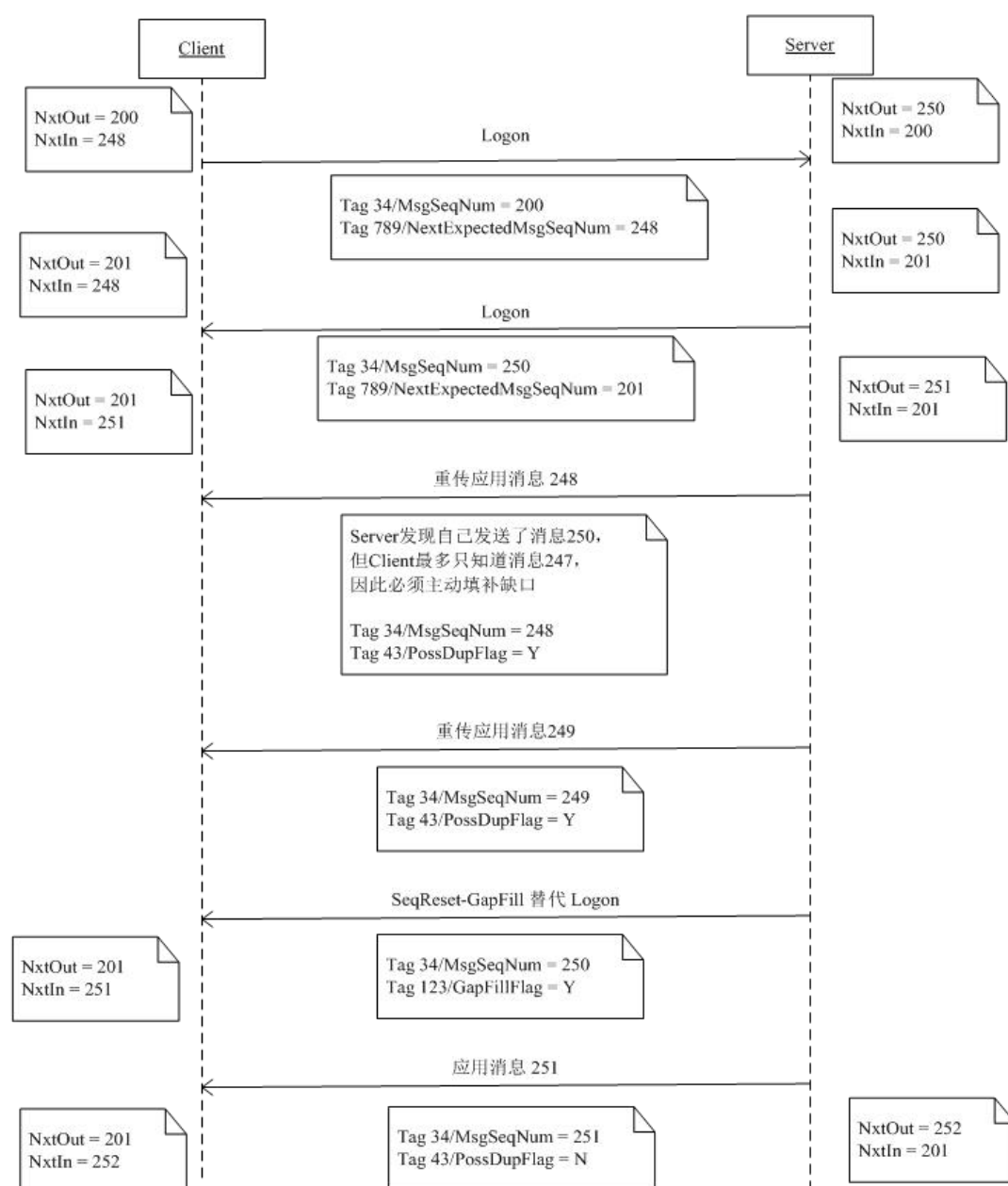


图 C.3 正常登录场景三

C.4 异常登录场景一

FIXT参与方作为登录发起方——Client，LFIXT参与方作为登录接受方——Server，日间非首次正常登录，且Client不设置ResetSeqNumFlag，也没有设置NextExpectedMsgSeqNum为其在前一次连接断开时的NxtIn。

场景开始时，TCP连接刚建立后，Client的NxtOut=100，NxtIn=189，Server的NxtOut=1，NxtIn=1。场景流程图如图C.4所示。

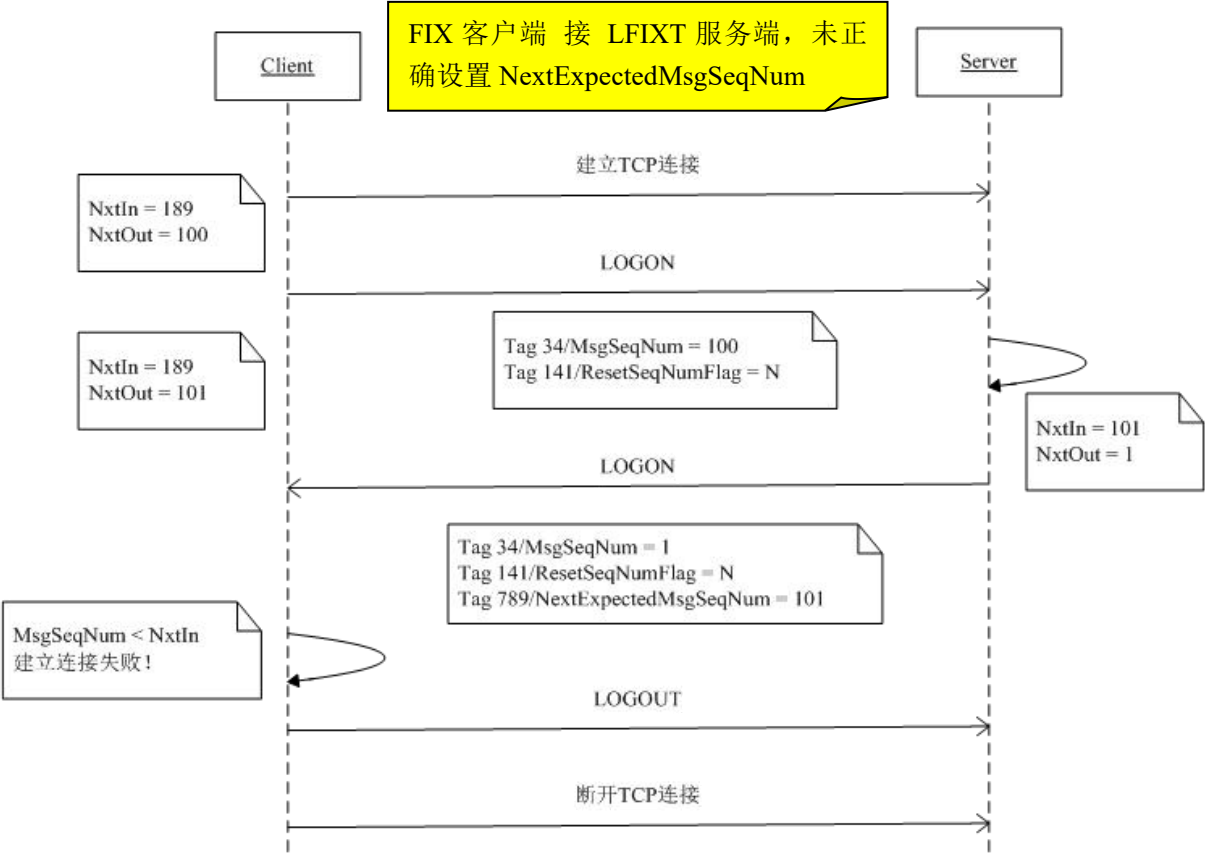


图 C.4 异常登录场景一

针对上图作一说明：由于FIXT作为客户端没有正确设置NextExpectedMsgSeqNum，收到的LOGON响应报文的MsgSeqNum是1，小于预期的189，因此FIXT作为客户端认为出现了严重错误，在发送LOGOUT后断开连接。

C.5 异常登录场景二

LFIXT参与方作为登录发起方——Client，LFIXT参与方作为登录接受方——Server，其余情况同本节场景一，唯一的区别在于Client在LOGON消息中提供的用户名和口令非法。场景流程图如图C.5所示。

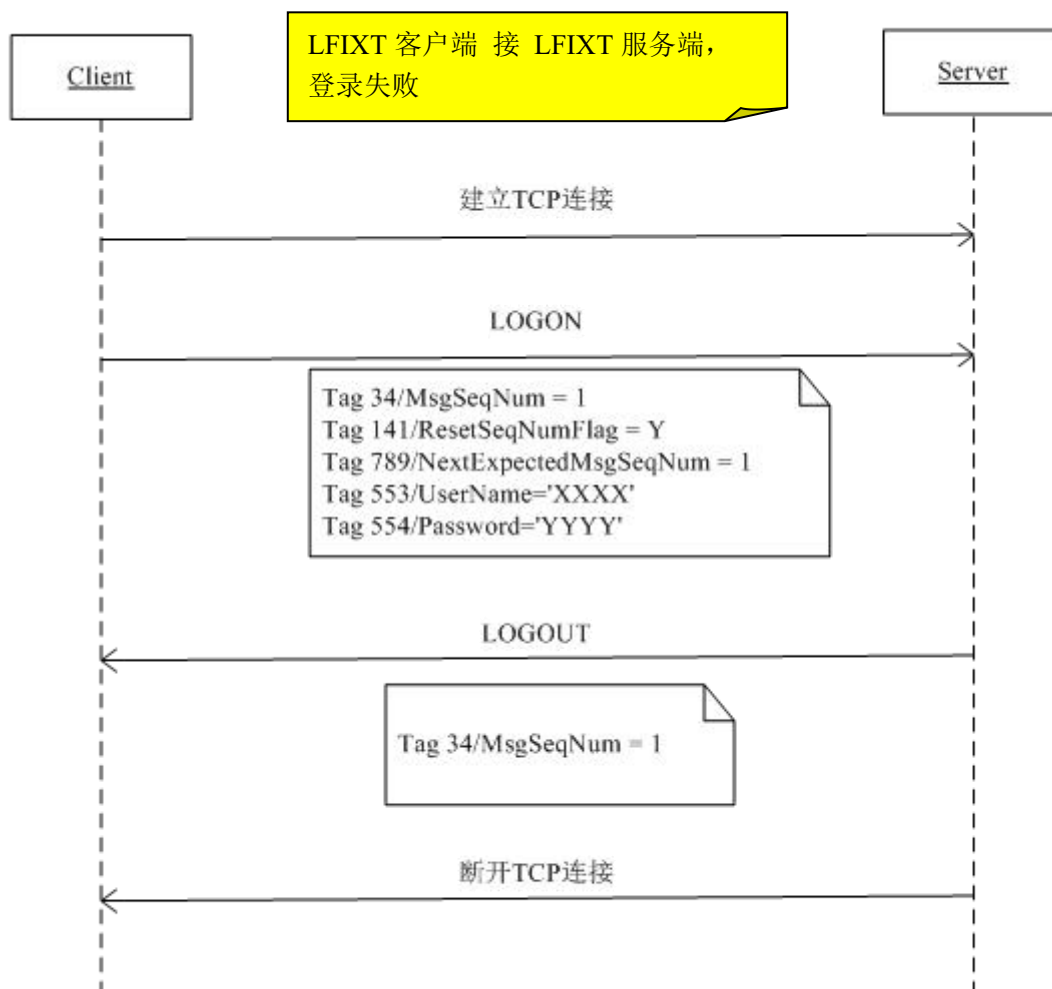


图 C.5 异常登录场景二

附 录 D
(规范性附录)
处理会话拒绝

LFIXT会话协议中，收到会话拒绝后应该记录日志，调整入向消息序号。下图（图D.1）中，Server是LFIXT参与方，Client是标准的FIXT参与方。

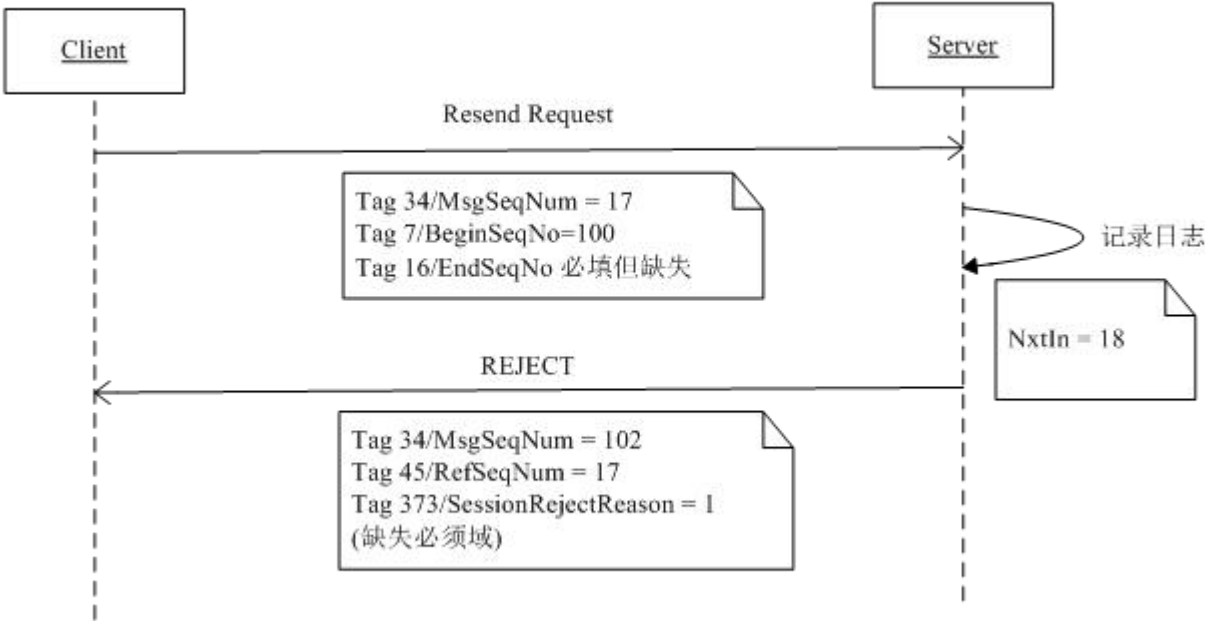


图 D.1 处理会话拒绝

附 录 E
(规范性附录)
处理重传请求场景

E.1 处理重传请求场景一

图E.1中，Client是FIXT参与方，Server是LFIXT参与方，且Client因为某种特殊的原因，比如虽然收到但因为自身错误而没有将消息98和99保留下来，但保存了消息100。

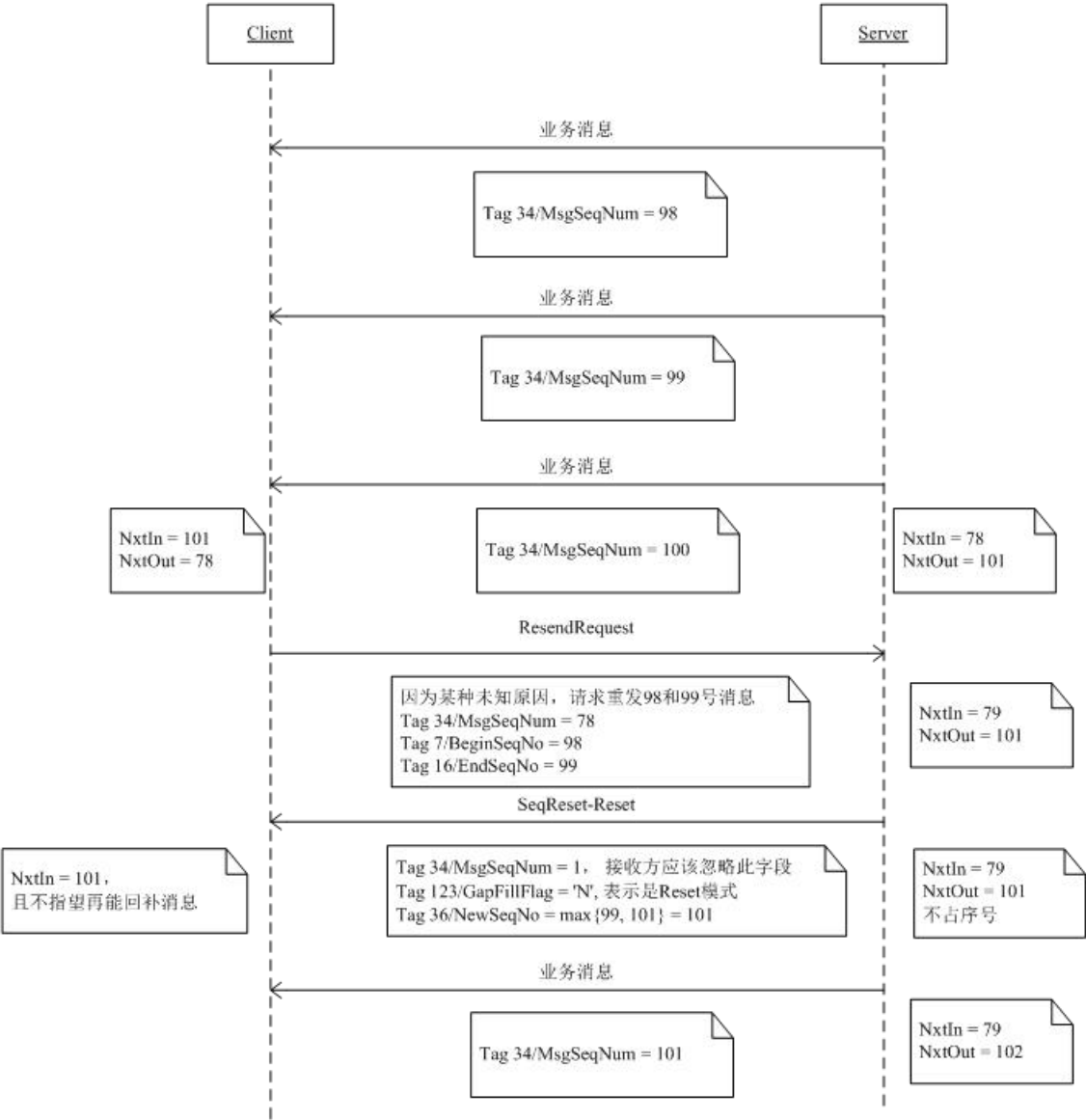
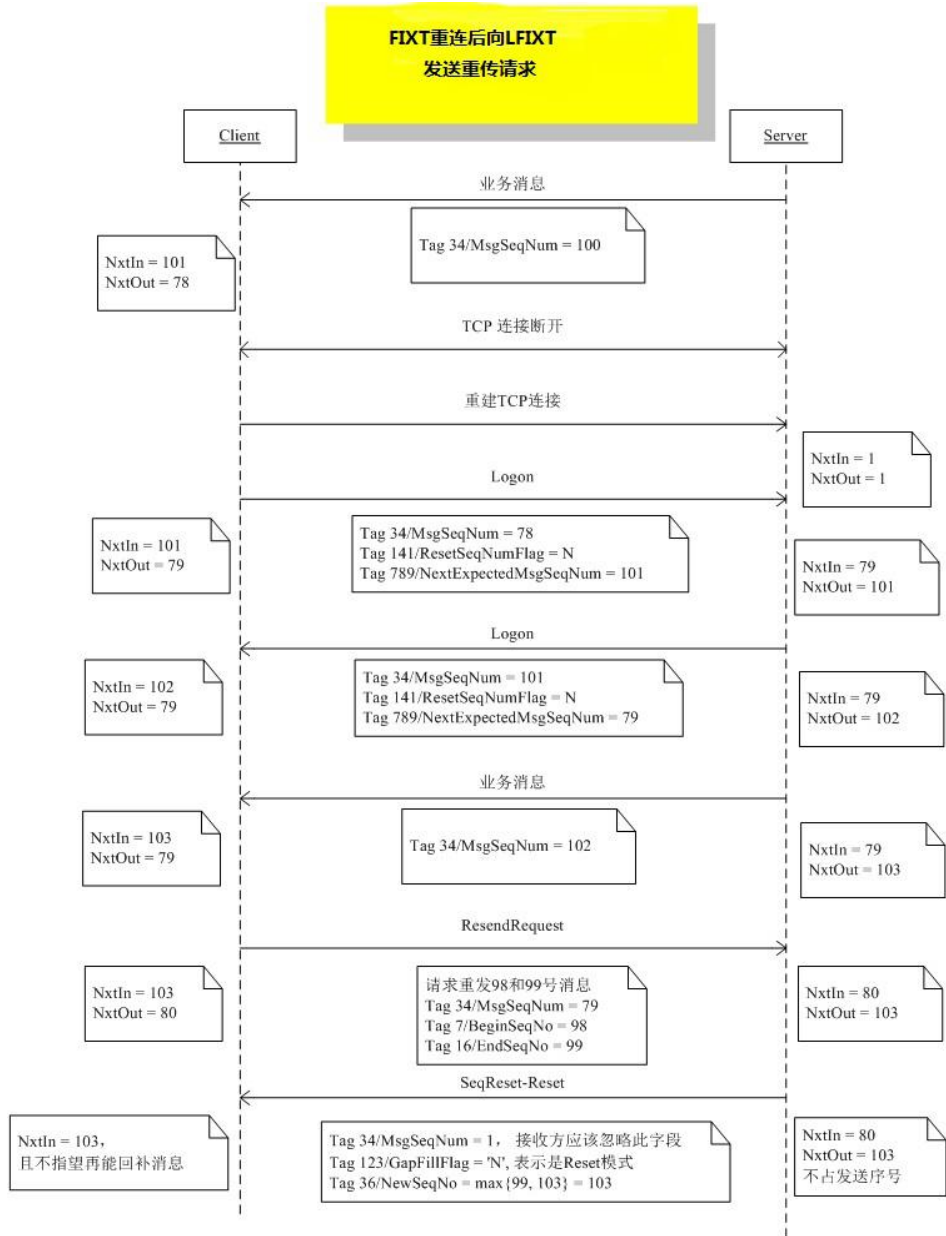


图 E.1 处理重传请求

E.2 处理重传请求场景二

和本节场景一前面部分都相同，但区别在于Client没有来得及发出ResendRequest，网络连接就断了，因此需要重新登录并后续发送ResendRequest补缺口。在登录时使用的NextExpectedMsgSeqNum是根据登录时已知的最大消息序号确定，而非根据全部缺口消息中最小的序号来确定。

场景流程图如图E.2所示。



图E.2 处理重传请求

附 录 F
(规范性附录)
注销场景

图F.1显示注销会话的场景，申请注销后，服务方回送注销消息确认断开会话。

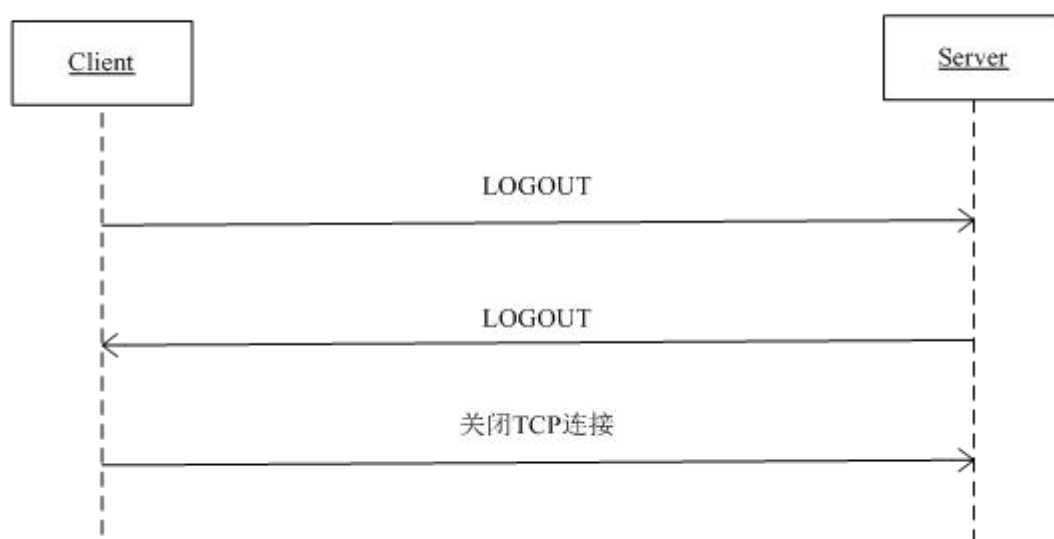


图 F.1 正常注销场景

中华人民共和国金融行业标准

JR/T 0183—2020

证券期货业投资者识别码

Investor identification code for securities and futures industry

2020 - 02 - 26 发布

2020 - 02 - 26 实施

中国证券监督管理委员会 发布

目 次

前言..... II

引言..... III

1 范围..... 1

2 术语和定义..... 1

3 编码长度及结构..... 1

4 编码分配..... 1

5 投资者名称命名规则..... 2

6 投资者身份识别证件类型..... 2

7 投资者身份识别证件号码..... 2

8 其他辅助识别信息..... 2

附录 A（资料性附录） 示例..... 3

前 言

本标准依据GB/T 1.1—2009给出的规则起草。

本标准由全国金融标准化技术委员会证券分技术委员会（SAC/TC180/SC4）提出。

本标准由全国金融标准化技术委员会（SAC/TC180）归口。

本标准起草单位：中国证券监督管理委员会信息中心、中国证券监督管理委员会证券基金机构监管部、中国证券监督管理委员会期货监管部、中国证券登记结算有限责任公司、中证信息技术服务有限责任公司、中国金融期货交易所。

本标准主要起草人：姚前、刘铁斌、孔庆文、周云晖、曹雷、祁博、冯天宁、刘明吉、王朝阳、刘大海、吴越、薛娜、何飞、高红洁、杨威、刘英、张宇翔。

引 言

为进一步规范我国多层次资本市场的投资者账户管理体系,建立证券期货业投资者身份识别编码申请及分配的统一规范,促进市场参与人之间的信息共享,制定本标准。

在本标准所建立的投资者身份识别码编码与分配机制基础上,证券交易市场、金融期货市场投资者身份识别已通过行业跨期现一码通账户体系的建设实现了统一,基金账户整合及制定基金账户开户规范也在稳步推进中。

证券期货业投资者识别码

1 范围

本标准规定了证券期货业投资者识别编码的术语和定义、编码长度及结构、编码分配、投资者名称命名规则、投资者身份识别证件类型、投资者身份识别证件号码、其他辅助识别信息。
本标准适用于为证券期货业市场的投资者分配统一的投资者识别码。

2 术语和定义

下列术语和定义适用于本文件。

2.1

编码分配机构 `code allocation institution`
为证券期货业投资者统一分配并管理识别编码的机构。

2.2

投资者识别码 `investor identification code`
由编码分配机构分配的识别证券期货业投资者身份信息的唯一代码。

2.3

产品投资者 `product investor`
自然人投资者、机构投资者以外的，具有独立财产归属含义的证券期货业投资者。
注：如证券投资基金、信托产品、集合理财产品等。

3 编码长度及结构

证券期货业投资者识别码为12位数字（见表1），由前2位投资者类型码和后10位自定义码组成：
a) 投资者类型码：由 2 位数字（“18”或“19”）组成的代表投资者类型的编码，自然人投资者类型码为“18”，机构及产品投资者类型码为“19”。
b) 自定义码：由 10 位数字组成，根据投资者识别码的申请顺序而自动生成的顺序编码。

表 1 证券期货业投资者识别码编码结构

投资者类型码	自定义码
前 2 位数字（18 或 19）	后 10 位顺序编码数字

4 编码分配

编码分配机构按照本标准确定的编码长度及结构分配证券期货业投资者识别码，并在编码分配前告知投资者需提供的要素信息。投资者申请投资者识别码时需提供以下三个要素信息：投资者名称、投资者身份识别证件类型、投资者身份识别证件号码，对于符合第 8 章情况的还需按照第 8 章要求提供其他相关辅助识别信息。编码分配示例参见附录 A。

5 投资者名称命名规则

投资者名称命名规则如下：

- a) 自然人投资者的名称为投资者姓名；
- b) 机构投资者的名称为机构全称；
- c) 产品投资者的名称具体参照产品主管机构规定的产品命名规则。

6 投资者身份识别证件类型

投资者身份识别证件包括主要身份识别证件和辅助身份识别证件。其中，辅助身份识别证件仅用于辅助核验投资者身份，不作为编码分配的主要依据。

主要身份识别证件类型包括：

- a) 境内自然人投资者主要身份识别证件为中华人民共和国居民身份证；
- b) 香港居民投资者主要身份识别证件为港澳居民来往内地通行证、港澳台居民居住证或香港居民身份证（辅助证件号码可填写来往内地通行证，但不作为分配投资者识别码的依据）；
- c) 澳门居民投资者主要身份识别证件为港澳居民来往内地通行证、港澳台居民居住证或澳门居民身份证（辅助证件号码可填写来往内地通行证，但不作为分配投资者识别码的依据）；
- d) 台湾居民投资者主要身份识别证件为来往大陆通行证或其他有效旅行证件；
- e) 获得中国永久居留资格的境外自然人投资者（除港、澳、台）身份识别证件为外国人永久居留证，其他境外自然人投资者（除港、澳、台）身份识别证件为护照，或所在地政府或我国政府认可的证照；
- f) 境内机构投资者的主要身份识别证件为加载统一社会信用代码的证照（尚未申领加载统一社会信用代码证照的投资者可使用原加载注册号或批文号等证件号码的证照）；
- g) 境内产品投资者的主要身份识别证件为产品管理人的加载统一社会信用代码的证照（尚未申领加载统一社会信用代码证照的投资者可使用原加载注册号或批文号等证件号码的证照）；
- h) 境外机构及产品的主要身份识别证件为所在地政府或我国政府认可的证照。

辅助身份识别证件类型包括：

- a) 自然人投资者的辅助身份识别证件包括军人身份证件、居住证、暂住证、护照、户口本、外国人永久居留证等；
- b) 境内机构投资者的辅助身份识别证件包括营业执照、机构信用代码证、LEI（全球法人机构识别编码）等；
- c) 境内产品投资者的辅助身份识别证件包括有权单位出具的备案文件、核准文件、批复文件、银行理财产品编码文件、非公募产品编码文件、私募基金产品编码文件、信托产品编码文件等。

7 投资者身份识别证件号码

投资者身份识别证件号码为第6章身份识别证件类型所唯一对应的号码。

8 其他辅助识别信息

对于仅有一个委托人的证券期货经营机构资产管理计划、保险资产管理计划等产品，需提供委托人名称、委托人身份识别证件类型、委托人身份识别证件号码。

附 录 A
(资料性附录)
示例

示例 1：“李 XX”作为自然人投资者申请投资者识别码，需提供中华人民共和国居民身份证相关信息，具体包括姓名（李 XX）、身份证号码（110105*****0403），编码分配机构依此为其分配投资者识别码 1801*****23。

示例 2：“ZX 证券公司”作为机构投资者申请投资者识别码，需提供加载统一社会信用代码的证照相关信息，具体包括全称（ZX 证券股份有限公司）、统一社会信用代码（9111*****），编码分配机构依此为其分配投资者识别码 1900*****10。

示例 3：“XX 保险资管集合资产管理计划”作为产品投资者申请投资者识别码，需提供加载统一社会信用代码的证照及产品相关信息，具体包括“保险资产管理公司简称—托管人简称—资产管理计划名称”（TP 保险资管—GS 银行—HY 资产管理计划），统一社会信用代码（9111*****），编码分配机构依此为其分配投资者识别码 1901*****75。

编码相关示例见表 A.1。

表 A.1 证券期货业投资者识别码编码示例

序号	投资者类型	投资者名称	投资者主要身份识别证件类型	投资者主要身份识别证件号码	投资者识别码 (一码通账户号)
示例 1	自然人投资者	李 XX	中华人民共和国居民身份证	110105*****0403	1801*****23
示例 2	机构投资者	ZX 证券股份有限公司	加载统一社会信用代码的证照	9111***** ***	1900*****10
示例 3	产品投资者	TP 保险资管—GS 银行—HY 资产管理计划	加载统一社会信用代码的证照	9111***** ***	1901*****75