编号: <u>TS-0407-001</u> 密级: <u>公开发布</u>



深圳证券交易所工程技术文档

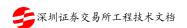
工程技术标准

深圳证券交易所数据接口规范

(Ver 4.53)

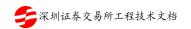


深圳证券交易所 中国结算深圳分公司 二〇〇七年四月



目 录

| ((4 : | 安口为 | 心心》 VER4.53 則 言 | I |
|--------------|-----|--------------------|----|
| 《扌 | 妾口敖 | 见范》VER4.52 前言 | 3 |
| 关 | 于本文 | た档 | 5 |
| 一、 | 交 | 易数据接口规范 | 10 |
| | 1. | 证券信息库SJSXX.DBF | 10 |
| | 2. | 新证券信息库SJSXXN.DBF | 14 |
| | 3. | 行情库SJSHQ.DBF | 22 |
| | 4. | 指数库SJSZS.DBF | 25 |
| | 5. | 委托库SJSWT.DBF | 25 |
| | 6. | 回报库SJSHB.DBF | 30 |
| 二、 | 信 | 息公告接口规范 | 35 |
| | 7. | 信息公告文件XXYYMMDD.NNN | 35 |
| 三、 | 股 | 份结算接口规范 | 39 |
| | 8. | 股份结算信息库SJSGF.DBF | 39 |
| | 9. | 股份结算对帐库SJSDZ.DBF | 56 |
| | 10. | 证券交易统计库SJSTJ.DBF | 56 |
| | 11. | B股结算指令库SJSZL.DBF | 57 |
| | 12. | B股结算指令状态库SJSZT.DBF | 58 |
| | 13. | 席位信息库SJSXW.DBF | 59 |
| | 14. | 代理信息库SJSDL.DBF | 60 |
| | 15. | LOF结算信息库LOFJS.DBF | 60 |
| 四、 | 资 | 金结算接口规范 | 64 |
| | 16. | 资金清算库SJSQS.DBF | 64 |
| | 17. | 资金结算信息库SJSZJ.DBF | 66 |
| 五、 | 开 | 户登记接口规范 | 72 |
| | 18. | 开户委托库SJSKW.DBF | 72 |
| | 19. | 开户回报库SJSKB.DBF | 76 |
| | 20. | 开户统计库SJSKT.DBF | 78 |
| 六、 | 结 | 算参与人文件传送接口规范 | 81 |
| | 21. | 结算参与人申请库SJSSQ.DBF | 81 |
| | 22. | 结算参与人确认库SJSQR.DBF | 85 |
| 七、 | 结 | 算参与人实时传送接口规范 | 87 |
| | 23. | 非交易报送库FJYBS.DBF | 87 |
| | 24. | 非交易确认库FJYQR.DBF | 90 |
| | | | |



《接口规范》 Ver4.53 前言

一、目标说明

根据业务发展需要,深圳证券交易所对证券信息库的相关约定进行了小的调整。本次对原数据接口规范(Ver4.52)进行了如下调整:

- 1. 表 1-1 增加"证券代码【115000, 115999】为分离交易型可转债的证券 代码区间"说明;
- 2. SJSXX.DBF 和 SJSXXN.DBF 中的证券级别定义增加 'B': 协议转让成 交即时确认证券;
- 3. 修订 SJSXXN.DBF 中证券简称前缀定义(表 1-3), 第四位增加取值 'A': 上市公司于交易日下午收市前通过指定网站发布公告提示;
- 4. SJSGF.dbf 中的"QFII 证券交易记录"(业务类别为'0B'和'0S'),增加了大宗交易的标识。若 GFWTXH='DZ',表示该笔交易为大宗交易。
- 5. 修订 SJSGF.dbf 中关于"LOF/ETF 连续认购方式"的发行数据说明,以 支持在最后申购日申购总量超过发行规模上限时进行比例配售。

二、相关事宜

本版规范由深交所电脑工程部和中国结算深圳分公司电脑工程部负责起草, 负责对本次修订部分的解释。

通信地址 : 深圳市深南东路 5045 号深圳证券交易所电脑工程部

邮政编码 : 518010

联系电话 : 0755-82083500、25918187(深交所工程部)

0755-25946080(中国结算深圳分公司电脑工程部)

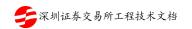
传 真: 0755-82083944 (深交所工程部)

0755-25987633(中国结算深圳分公司电脑工程部)

E-mail : ssegcb@szse.cn szjsb@chinaclear.com.cn

网站地址 : www.szse.cn www.chinaclear.cn

网上咨询 : http://www.szse.cn/Consultation/ConLogin.aspx



深圳证券交易所 中国结算深圳分公司 二〇〇七年四月二十四日



《接口规范》 Ver4.52 前言

一、目标说明

根据业务发展需要,深圳证券交易所对证券信息库的相关约定进行了小的调整。另外,由于业务上的原因,T+1DVP结算模式改革暂缓实行,本次接口修订后不再含有T+1DVP相关的内容,该部分接口将在适当的时候再行约定。本次对原数据接口规范(Ver4.51)进行了如下调整:

- 1. 修订 SJSXXN.DBF 中证券简称前缀的定义 (表 1-3); 表 1-1 增加"证券 代码【037001,037999】为上市公司股权激励计划涉及的员工认股权的 证券代码区间"说明;
- 2. 修订了 T+1DVP 相关的内容,修订后本接口不再含有 T+1DVP 内容;
- 3. 为配合 2006 年 9 月 18 日深交所发布的《关于深市新股资金申购上网发行的补充通知》,修订了 SJSGF.DBF 中对新股发行上网定价方式相关日期的说明;
- 4 FJYBS DBF 增加了沪市账户挂账股份补登记业务的相关说明。

本次修订部分用红色标记。在此基础上形成了《深圳证券交易所数据接口规范》(Ver4.52)(深交所工程标准化代号 TS-0406-007)。

二、相关事宜

本版规范由深交所电脑工程部和中国结算深圳分公司电脑工程部负责起草,负责对本次修订部分的解释。

通信地址 : 深圳市深南东路 5045 号深圳证券交易所电脑工程部

邮政编码 : 518010

联系电话 : 0755-82083500、25918187(深交所工程部)

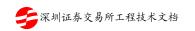
0755-25946080 (中国结算深圳分公司电脑工程部)

传 真: 0755-82083944 (深交所工程部)

0755-25987633 (中国结算深圳分公司电脑工程部)

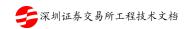
E-mail : ssegcb@szse.cn szjsb@chinaclear.com.cn

网站地址 : www.szse.cn www.chinaclear.cn



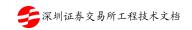
网上咨询 : http://www.szse.cn/Consultation/ConLogin.aspx

深圳证券交易所 中国结算深圳分公司 二〇〇六年十二月十一日



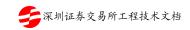
关于本文档

| 日期 | 版本 | 修订说明 |
|---------|----------|---|
| 2001-10 | Ver 4.0 | 针对原有数据接口规范存在的问题和证券市场新的发展需求,重新制定了数据接口规范,以Ver4.0发布,于2001年11月12日与第四代交易结算系统同时启用。 |
| 2003-05 | Ver 4.1 | 在前一版本的基础上,为适应国债净价交易、二级市场市值配售、企业债回购等业务的开展,以及为了适应即将开展的QFII、上市公司流通股份要约收购等业务,进行了修订,形成Ver4.1。主要修订如下: 1. 为解决会员集中报盘后证券营业部编码的需要,重新定义了委托库(SJSWT.dbf)合同序号WTHTXH字段的含义。 2. 因市值配售新股业务的需要,修改了委托库(SJSWT.dbf)、回报库(SJSHB.DBF)、证券信息库(SJSXX.DBF)相关字段的内涵。 3. 为实施企业债券回购,对回报库(SJSHB.DBF)、证券信息库(SJSXX.DBF)相关字段作了新的约定。 4. 为实施"上市公司收购管理办法",委托库(SJSWT.dbf)增加了四类指令、回报库(SJSHB.DBF)增加了六类指令,股份结算信息库(SJSGF.DBF)增加了三类指令。 |
| 2003-08 | Ver 4.2 | 为进一步提高深圳B股市场运行的效率和安全性,将《深圳证券交易所B股结算数据接口规范》(Ver 3.2)和《深圳证券交易所数据接口规范》(Ver 4.1)进行了修订和整合,形成了Ver 4.2。主要修订如下: 1. 本版本接口规范继承了《深圳证券交易所数据接口规范》(Ver 4.1)的全部内容。 2. 本版本接口规范合并了《深圳证券交易所 B 股结算数据接口规范》(Ver 3.2)的全部内容,因此股份结算信息库 SJSGF.dbf、股份结算对帐库 SJSDZ.dbf、证券交易统计库 SJSTJ.dbf、资金结算信息库 SJSZJ.dbf 成为 A、B 股共用的结算接口库。 3. 新增加了用于境外券商二类指令业务的 B 股结算指令库 SJSZL.dbf 和 B 股结算指令状态库 SJSZT.dbf。 4. "开户登记接口规范"中的各接口库的定义没有改变,但原 A 股证券账户的各类委托业务(如挂失补办、合并、注销、资料更改、资料查询等)对 B 股证券账户同样有效。 5. 原 8 位长度的 B 股证券账户号码统一升为 10 位长度的新 B 股证券账户号码。 |
| 2004-02 | Ver 4.3 | 在前一版本的基础上,对行情数据库SJSHQ.DBF进行了修改:将行情库 买卖盘价位的数量从四个增加到五个,并重新约定了第四价位买卖盘的 含义,形成Ver4.3。 |
| 2004-07 | Ver 4.31 | 在前一版本的基础上,为适应LOF业务,进行了修订,形成Ver4.31。主要修订如下: 1. 对委托库 SJSWT.DBF 的说明进行了修订,增加了关于进行 LOF 跨 |

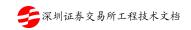


| 日期 | 版本 | 修订说明 |
|---------|----------|---|
| | | 系统转托管的报盘说明。 2. 对股份结算信息库 SJSGF.DBF 中的相关说明进行了修订,归纳整理了所有发行方式下返回数据的详细说明。 3. 对席位信息库 SJSXW.DBF 的说明进行了修订,增加了关于开放式基金代销人的信息。 4. 对资金结算信息库 SJSZJ.DBF 的资金用途进行了修订,针对 LOF 发行的资金清算增加了两个新的资金用途代号,针对 B 股卖空增加了一个新的资金用途代号。 |
| 2004-12 | Ver 4.32 | 5. 增加了一个代理信息库 SJSDL.DBF, 供券商办理 LOF 跨系统转托管业务时使用。 在前一版本的基础上, 为配合通过行情系统开放式基金(含LOF)揭示净值、成交量统计指标、网络投票业务等新业务的推出, 进行了修订, 形成Ver4.32。主要修订如下: |
| | | 对行情数据库 SJSHQ.DBF 进行了修改,增加了开放式基金(含 LOF) 净值揭示和成交量统计指标的说明。 对委托库 SJSWT.DBF 的说明进行了修订,增加了关于上市公司股东 大会网络投票、深交所投资者服务密码激活与挂失的报盘说明。 |
| 2005-03 | Ver 4.33 | 在前一版本基础上,为适应交易系统开展开放式基金(含LOF)申购、赎回业务的需求,进行了修订,形成Ver4.33。主要修订如下: 1. 对于交易数据接口规范,修订了委托库 SJSWT.DBF 和回报库 SJSHB.DBF,增加了开放式基金申购赎回报盘和成交回报类数据。 2. 对于股份结算接口规范,增加了 LOF 结算信息库 LOFJS.DBF,该库 为通过深交所办理开放式基金业务的专用结算数据库,仅面向具有开 放式基金代销业务资格的证券商使用。 |
| 2005-09 | Ver 4.34 | 在前一版本基础上,为配合股权分置改革试点,并适应权证业务发展的需要,进行了修订,形成Ver4.34。主要修订如下: 1. 交易数据接口规范方面,在证券信息库SJSXX.DBF约定了权证类证券的基本信息。同时修订了委托库SJSWT.DBF和回报库SJSHB.DBF,增加了有关权证行权申报和行权成交回报类的业务数据。 2. 股份结算接口规范方面,修订了股份结算信息库SJSGF.DBF,增加了行权申请回报、行权交收回报等新业务,重新解释了股份结算对账库SJSDZ.DBF中总拥股数的定义 3. 对于资金结算接口规范,新增了一个数据接口——资金清算库SJSQS.DBF,目前仅包含权证的交易和行权的资金清算数据。同时还修订了资金结算信息库SJSZJ.DBF,增加了权证业务相关的资金用途代号。 |
| 2005-11 | Ver 4.35 | 在前一版本基础上,为了配合交易型开放式指数基金(ETF)产品及引入市价委托等交易制度创新的推出,进行了修订,形成Ver4.35。主要修订如下: 1. 交易数据接口规范方面,在证券信息库SJSXX.DBF中增加了ETF和非 |

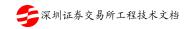
深圳证券交易所



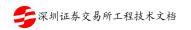
| 日期 | 版本 | 修订说明 |
|---------|----------|--|
| | | 交易类开放式基金的证券级别定义,同时修订委托库SJSWT.DBF和回报库SJSHB.DBF,增加ETF申购、赎回的报盘及回报类业务数据,增加五种市价委托的报盘类业务数据,增加部分撤单原因定义,增加在大宗交易成交回报后的全天市场闭市标志。 2. 股份结算接口规范方面,修订了股份结算信息库SJSGF.DBF,增加了ETF申购/赎回现金差额、现金替代多退少补等业务类别。 3. 对于资金结算接口规范,修订了资金清算库SJSQS.DBF,增加了ETF申购、赎回、现金差额、现金替代多退少补等业务,同时还修订了资金结算信息库SJSZJ.DBF,增加了ETF的相关资金用途代号。 |
| 2006-03 | Ver 4.36 | 在前一版本基础上,为了配合开展协助执法机关冻结流通证券业务和深市投资者开设证券账户同时开通网上查询服务业务,进行了修订,形成Ver4.36。主要修订如下: 1. 增加了结算参与人接口规范。这一部分的数据接口说明,目前仅适用于通过D-COM系统(含IST终端)进行规范性数据接口传送的接口文件。 2. 股份结算接口规范方面,修订了股份结算信息库SJSGF.DBF,增加了流通股冻结、交收锁定等业务类别,同时进一步明确了原有业务类别B2的业务含义,增加了要约收购结束当日的结算数据说明。 3. 开户登记接口规范方面,修订了开户委托库SJSKW.DBF和开户回报库SJSKB.DBF,增加了开通网络服务的业务类别。 |
| 2006-04 | Ver 4.37 | 在前一版本基础上,为了适应质押式回购业务,进行了修订,形成Ver4.37。主要修订如下: 1. 修订了SJSWT.DBF,增加了关于债券质押式回购转入、转出质押库的委托说明。 2. 修订了SJSGF.DBF,增加了关于转入、转出质押库回报的说明。 3. 修订了SJSZJ.DBF中,增加了欠库冻结资金的说明。此外,还对QFII的申购赎回数据进行了补充说明。 |
| 2006-06 | Ver 4.38 | 在前一版本基础上,为适应新股申购撤单和申购回报业务的需求,进行了修订,形成Ver4.38。主要修订如下: 1. 修订了委托库SJSWT.DBF,增加了新股申购撤单业务类别。 2. 修订了回报库SJSHB.DBF,增加了新股申购回报业务类别,并修改了原有业务类别7C的含义。 |
| 2006-06 | Ver 4.39 | 在前一版本基础上,为了适应融资融券业务,进行了修订,形成Ver4.39。主要修订如下: 1. 修订了SJSWT.DBF,增加了关于融资融券交易的委托说明。 2. 修订了SJSHB.DBF,增加部分自动撤单定义。 3. 修订了SJSGF.DBF,增加了相关业务类别。 4. 修订了SJSXW.DBF,增加了信用席位的信息。 5. 修订了SJSKW.DBF,增加了两类开户类别。 6. 增加了结算参与人实时传送接口规范。 |



| 日期 | 版本 | 修订说明 |
|---------|----------|---|
| 2006-07 | Ver 4.50 | 在前一版本的基础上,为了适应T+1DVP结算模式改革,进行了修订,形成Ver 4.50。主要修订如下: 1. 增加了SJSMX.DBF。 2. 修订了SJSTJ.DBF,调整了TJBGHF和TJSGHF的字段定义。 3. 修订了SJSGF.DBF的业务类别,增加了待处分券等业务确认、证券划回确认、投资者违约的回报,取消了QFII成交回报、交收锁定回报,调整了业务类别为'B2'的业务含义,并将质押式回购出入库的回报从原来的质押回报业务中独立出来,业务类别为'74',权证行权的回报('W0','W1','W2','W3','W4')中,将扣除税费后的应交付金额改为未扣税费的应交付金额,同样在要约收购的回报('78')中,将扣除税费后的转让金额改为未扣税费的转让金额,取消原有通过业务类别('41')返回非担保大宗交易(专项资产管理计划)的交收结果,改为通过业务类别('DZ')进行回报。 4. 修订了SJSQS.DBF,增加了相关业务的说明。 5. 修订了FJYBS.DBF,增加了待处分券报送、流通股冻结等业务的委托说明。 6. 增加了部分错误代码解释和资金用途解释。 |
| 2006-08 | Ver 4.51 | 在前一版本的基础上,为了适应证券信息发布优化改造,进行了修订, 形成了Ver 4.51。主要修订如下: 1. 修订了SJSXX.DBF中XXZQJB字段取值含义。 2. 增加了SJSXXN.DBF。 3. 修订了SJSHQ.DBF首条特殊记录的部分字段说明。 4. 增加了信息公告接口约定。 此外,还对T+1DVP结算模式改革中的数据接口进行了部分修订和细化 说明。 |
| 2006-12 | Ver4.52 | 在前一版本的基础上,为了适应证券信息发布优化改造和T+1 DVP业务发展情况,进行了修订,形成了Ver 4.52, 主要修订如下: 1. 修订SJSXXN.DBF中证券简称前缀的定义(表1-3);表1-1增加"证券代码【037001,037999】为上市公司股权激励计划涉及的员工认股权的证券代码区间"说明; 2. 修订了T+1DVP相关的内容,修订后本接口不再含有T+1DVP内容; 3. 为配合2006年9月18日深交所发布的《关于深市新股资金申购上网发行的补充通知》,修订了SJSGF.DBF中对新股发行上网定价方式相关日期的说明; 4. FJYBS.DBF增加了沪市账户挂账股份补登记业务的相关说明。 |
| 2007-4 | Ver4.53 | 在前一版本基础上,因业务需要进行了修订,形成Ver4.53, 主要修订如下: 1. 表1-1增加"证券代码【115000, 115999】为分离交易型可转债的证券代码区间"说明; 2. SJSXX.DBF和SJSXXN.DBF中的证券级别定义增加'B':协议转让 |



| 日期 | 版本 | 修订说明 |
|----|----|---|
| | | 成交即时确认证券; 3. 修订SJSXXN.DBF中证券简称前缀定义(表1-3),第四位增加取值 'A':上市公司于交易日下午收市前通过指定网站发布公告提示; 4. SJSGF.dbf中的"QFII证券交易记录"(业务类别为'0B'和0S),增加了大宗交易的标识。若GFWTXH='DZ',表示该笔交易为大宗交易。 |
| | | 5. 修订SJSGF.dbf中关于"LOF/ETF连续认购方式"的发行数据说明。 |

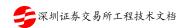


一、 交易数据接口规范

本部分规范描述了证券商柜台系统同深交所交易系统之间接口数据库,包括证券信息库(SJSXX.dbf)、新证券信息库(SJSXXN.dbf)、行情库(SJSHQ.dbf)、指数库(SJSZS.dbf)、委托库(SJSWT.dbf) 以及回报库(SJSHB.dbf)等6个数据库。

1. 证券信息库 SJSXX.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|----------|----|------|----------|
| 1 | XXZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 2 | XXZQJC | 证券简称 | C | 8 | |
| 3 | XXYWJC | 英文简称 | C | 20 | |
| 4 | XXJYDW | 交易单位 | N | 4,0 | |
| 5 | XXHYZL | 行业种类 | C | 3 | |
| 6 | XXHBZL | 货币种类 | C | 2 | |
| 7 | XXMGMZ | 每股面值 | N | 7,2 | |
| 8 | XXZFXL | 总发行量 | N | 12,0 | |
| 9 | XXLTGS | 流通股数 | N | 12,0 | |
| 10 | XXSNLR | 上年每股利润 | N | 9,4 | |
| 11 | XXBNLR | 本年每股利润 | N | 9,4 | |
| 12 | XXJSFL | 经手费率 | N | 7,6 | 按成交金额计算 |
| 13 | XXYHSL | 印花税率 | N | 7,6 | 按成交金额计算 |
| 14 | XXGHFL | 过户费率 | N | 7,6 | |
| 15 | XXSSRQ | 上市日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 16 | XXDJRQ | 到期/交割日 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 17 | XXMBXL | 每笔限量 | N | 9,0 | |
| 18 | XXBLDW | 买数量单位 | N | 6,0 | |
| 19 | XXSLDW | 卖数量单位 | N | 6,0 | |
| 20 | XXJGDW | 价格档位 | N | 5,3 | |
| 21 | XXJHCS | 集合竞价限价参数 | N | 7,3 | |
| 22 | XXLXCS | 连续竞价限价参数 | N | 7,3 | |
| 23 | XXXJXZ | 限价参数性质 | N | 1,0 | |
| 24 | XXZTJG | 涨停价格 | N | 9,3 | |
| 25 | XXDTJG | 跌停价格 | N | 9,3 | |
| 26 | XXZHBL | 折合比例 | N | 5,2 | |
| 27 | XXJYZT | 交易状态 | C | 1 | |
| 28 | XXZQJB | 证券级别 | C | 1 | |
| 29 | XXTPBZ | 停牌标志 | C | 1 | |
| 30 | XXCQCX | 除权除息标志 | C | 1 | |
| 31 | XXCFBZ | 成份股标志 | C | 1 | |



- (1) 本库的第一条记录为特殊记录, **XXZQDM**(字段 1: 证券代码)为 "000000", **XXZQJC**(字段 2: 证券简称)存放当前日期 CCYYMMDD, **XXBLDW**(字段 18: 买数量单位)存放库更新时间, **XXSLDW**(字段 19: 卖数量单位)存放当日挂牌证券的数量。
- (2) **XXZQDM**(字段1:证券代码)为关键字,最左两位作为证券种类标识码(见表1-1),其中首位标识证券大类,第二位标识该大类下的衍生证券,证券代码的后四位为顺序码。

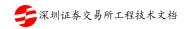
| 第一位 | 第二位 | 定义 |
|-----|-----|---------------------|
| | 0 | A股证券 |
| 0 | 3 | A 股认购或认沽权证 (注 1) |
| 0 | 7 | A股增发 |
| | 8 | A股配股权证 |
| | 0 | 国债现货 |
| | 1 | 债券 (注2) |
| | 2 | 可转换债券 |
| 1 | 3 | 债券回购 |
| | 5 | 开放式基金 (注3) |
| | 6 | 开放式基金 (注3) |
| | 8 | 证券投资基金 |
| 2 | 0 | B股证券 |
| 2 | 8 | B股权证 |
| | 0 | 创业板证券 |
| | 6 | 网络投票证券 (注 4) |
| 3 | 7 | 创业板增发 |
| | 8 | 创业板权证 |
| | 9 | 综合或成份指数/成交量统计指标(注5) |

证券类别定义表(表1-1)

注1: 其中,【030000,032999】是认购权证代码区间;【038000,039999】 是A股认沽权证代码区间;证券代码【037001,037999】为上市公司股权激 励计划涉及的员工认股权的证券代码区间;【033000,036999】为权证业务预 留的代码区间;

注 2: 其中,【115000, 115999】是分离交易型可转债的证券代码区间;

注 3: 其中, XXZQJB 字段值为'L'的, 是上市开放式基金(LOF); XXZQJB 字段值为'E'的是交易型开放式指数基金(ETF), ETF 基金代码区间为【159900, 159999】; XXZQJB 字段值为'F'的是非交易型开放式基金(暂不交易, 仅揭示基金净值及开放申购赎回业务); XXZQJB 字段值为'O'的是净



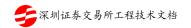
值揭示服务开放式基金。

注 4: 其中, 369999 为用于投资者服务密码激活/挂失处理的专用证券; 注 5: 其中, 代码以 395 开头的证券用于揭示成交量统计指标。

(3) XXYWJC (字段 3: 英文简称)。对于认购或认沽权证,英文简称字段格式为"NNNNNNSYYMMDDEYYMMDD",其中左六位为标的证券代码,中间的YYMMDD表示权证行权起始日,最右边的6位YYMMDD表示权证行权截止日。标的证券代码、行权起始日之间以"S"为间隔符,如果间隔符"S"后面为六位空格字符串,表示对应权证的行权起始日尚未确定或尚未被触发;行权起始日、行权截止日之间以"E"为间隔符,如果间隔符"E"后面为六位空格字符串,表示对应权证的行权截止日尚未确定或尚未被触发。

例如英文简称"000001S050628E050828"表示权证的标的证券代码是000001,行权起始日是2005年6月28日,行权截止日是2005年8月28日。

- (4) XXJYDW (字段 4: 交易单位),指接口库 SJSWT.dbf (委托库)中WTWTSL (委托数量)的单位量,即最终的委托量=(SJSXX.XXJYDW*SJSWT.WTWTSL)。例如某证券的 SJSXX.XXJYDW=10(股),SJSWT.WTWTSL=1000,则该证券的委托量=SJSWT.WTWTSL*SJSXX.XXJYDW=10000股。
- (5) **XXHYZL**(字段 5: 行业种类),对于股票,左边第一位为字母,其余两位为数字或空格,具体定义请参见中国证监会颁布的《上市公司行业分类指引》的大类划分。对于认购或认沽权证,最左边的第1位字符代表权证类别,其中"C"表示认购权证,"P"表示认沽权证;中间1位字符代表权证行权方式,其中"A"表示美式权证行权、"E"表示欧式权证行权、"B"表示百慕大式权证行权;最后1位字符代表权证结算方式,其中"C"表示现金结算方式,"S"表示证券给付结算方式。
 - (6) XXHBZL (字段 6: 货币种类), '00'人民币, '01'港币, '02'美元。
- (7) **XXMGMZ**(字段 7: 每股面值)。对于认购或认沽权证,存放每百份权证的行权比例值,即表示权证行权时每 100 份权证对等的标的证券的数量。
- (8) **XXSNLR**(字段 10: 上年每股利润),对于债券类,存放债券票面年利率;对于基金(含封闭式基金和开放式基金),存放每基金单位净资产值;对附息和零息国债,存放票面年利率;对贴现国债,存放贴现发行价;对于认购或认沽权证,存放每份标的证券的行权价格。
- (9) **XXBNLR**(字段 11: 本年每股利润),对于国债,存放每百元应计利息额;对于采用现金结算的认购或认沽权证,存放每份标的证券的结算价格。



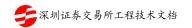
- (10) **XXJSFL**(字段 12: 经手费率),为交易所本身或代为向投资者收取的交易费用的费率(包含证券交易规费、交易经手费等)乘以 100,即字段值除以 100 后为实际经手费率。
- (11) **XXGHFL**(字段 14: 过户费率),创业板按每笔成交股份面值计算, B股按成交金额计算。
- (12) **XXSSRQ**(字段 15: 上市日期)与 **XXDJRQ**(字段 16: 到期/交割日)的日期格式为 **CCYYMMDD**。对于国债现货, **XXSSRQ**(字段 15: 上市日期)为发行起息日或本次付息起息日;对于国债现货和债券, **XXDJRQ**(字段 16: 到期日/交割日)存放该债券到期日。
- (13) **XXMBXL**(字段 17: 每笔限量)指 **SJSWT.WTWTSL**(委托数量)的上限。
- (14) 每笔买委托的 **SJSWT.WTWTSL**(委托库字段 14: 委托数量) 必须 是 **XXBLDW**(字段 18: 买数量单位)的整数倍。
- (15) 每笔卖委托的 SJSWT.WTWTSL (委托库字段 14: 委托数量) 必须 是 XXSLDW (字段 19: 卖数量单位) 的整数倍。
- (16) **XXJGDW**(字段 20: 价格档位)为 **SJSWT.WTWTJG**(委托价格)的最小变动单位,例如 0.01 元 RMB。
- (17) XXJHCS(字段 21:集合竞价限价参数)。如 XXJHCS>0,则集合竞价的有效竞价范围为:[MAX(XXJGDW,SJSHQ.HQZRSP-((SJSHQ.HQZRSP-1)*XXXJXZ+1)*XXJHCS),SJSHQ.HQZRSP+((SJSHQ.HQZRSP-1)*XXXJXZ+1)*XXJHCS]

如该证券同时设有涨跌幅限制,则取上述范围与涨跌幅限价范围的交集。在此范围内的委托才有资格参加集合竞价。

(18) XXLXCS(字段 22: 连续竞价限价参数)。如 XXLXCS>0,则连续竞价的有效竞价范围为: [MAX (XXJGDW , SJSHQ.HQZJCJ-((SJSHQ.HQZJCJ-1) *XXXJXZ+1) *XXLXCS), SJSHQ.HQZJCJ+((SJSHQ.HQZJCJ-1)*XXXJXZ+1)*XXLXCS],如 STSHQ.HQZJCJ 值为 0,则用 SJSHQ.HQZRSP 替代。

如该证券同时设有涨跌幅限制,则取上述范围与涨跌幅限价范围的交集。价格在此范围内的委托才有资格参加当时的连续竞价。

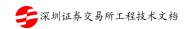
(19) **XXXJXZ**(字段 23: 限价参数性质)。0 表示 **XXJHCS** 和 **XXLXCS** 的值为价格; 1表示 **XXJHCS** 和 **XXLXCS** 的值为比例数。



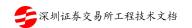
- (20) **XXZTJG**(字段 24: 涨停价格)为涨跌幅限制的价格上限,如果 **XXZTJG**=99999.999,则相应的证券没有涨幅限制; **XXDTJG** (字段 25: 跌停价格)为涨跌幅限制的价格下限,如果 **XXDTJG=0**,则相应的证券没有跌幅限制。
- (21) **XXZHBL**(字段 26: 折合比例)。 对国债现券,表示该种国债折合成 131990 综合券的比例;对企业债券,表示该种企业债折合成 131991 综合券的比例。
- (22) **XXJYZT**(字段 27: 交易状态)。'Y'首日上市;'Z'增发股份上市;'N' 通常状态;'F'证券上网定价发行;'I'证券上网竞价发行;'P'国债挂牌分销。
- (23) **XXZQJB**(字段 28: 证券级别)。'N'Normal;'S'ST 股票;'*'*ST 股票;'P'股份转让;'L'上市开放基金 LOF;'E'交易型开放式指数基金(ETF);'F'非交易型开放式基金(暂不交易,仅揭示基金净值及开放申购赎回业务);'O'仅提供净值揭示服务的开放式基金;'B'协议转让即时成交确认证券。
 - (24) **XXTPBZ** (字段 29: 停牌标志)。'T'停牌;'F'正常交易。
- (25) **XXCQCX**(字段 30: 除权除息标志), "N"表示正常状态, "E"表示除权, "D"表示除息, "A"表示除权除息。
- (26) **XXCFBZ**(字段 31: 成份股标志), "Y"表示该证券为成份股; "T" 表示该证券为成份股, 但暂不纳入指数计算; "Z"表示该证券为非成份股, 但纳入综合指数计算; "N"其它。

2. 新证券信息库 SJSXXN.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|----------|----|------|----|
| 1 | XXZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 2 | XXZQJC | 证券简称 | C | 8 | |
| 3 | XXJCQZ | 证券简称前缀 | С | 4 | |
| 4 | XXYWJC | 英文简称 | С | 20 | |
| 5 | XXJCZQ | 基础证券 | С | 6 | |
| 6 | XXISIN | ISIN 编码 | C | 12 | |
| 7 | XXHYZL | 行业种类 | С | 3 | |
| 8 | XXHBZL | 货币种类 | С | 2 | |
| 9 | XXMGMZ | 每股面值 | N | 7,2 | |
| 10 | XXZFXL | 总发行量 | N | 12,0 | |
| 11 | XXLTGS | 流通股数 | N | 12,0 | |
| 12 | XXSNLR | 上年每股利润 | N | 9,4 | |
| 13 | XXBNLR | 本年每股利润 | N | 9,4 | |
| 14 | XXLJJZ | 基金份额累计净值 | N | 9,4 | |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|-------------|------------|----|-----|-------------|
| 15 | XXJSFL | 经手费率 | N | 7,6 | 按成交金额计算 |
| 16 | XXYHSL | 印花税率 | N | 7,6 | 按成交金额计算 |
| 17 | XXGHFL | 过户费率 | N | 7,6 | |
| 18 | XXSSRQ 上市日期 | | D | 8 | CCYYMMDD |
| 19 | XXQXRQ | 债券起息日 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 20 | XXDJRQ | 到期/交割日 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 21 | XXJYDW | 交易单位 | N | 4,0 | |
| 22 | XXBLDW | 买数量单位 | N | 6,0 | |
| 23 | XXSLDW | 卖数量单位 | N | 6,0 | |
| 24 | XXMBXL | 每笔委托限量 | N | 9,0 | |
| 25 | XXJGDW | 价格档位 | N | 5,3 | |
| 26 | XXJHCS | 集合竞价限价参数 | N | 7,3 | |
| 27 | XXLXCS | 连续竞价限价参数 | N | 7,3 | |
| 28 | XXXJXZ | 限价参数性质 | N | 1,0 | |
| 29 | XXZTJG | 涨停价格 | N | 9,3 | |
| 30 | XXDTJG | 跌停价格 | N | 9,3 | |
| 31 | XXJGSX | 大宗交易价格上限 2 | N | 9,3 | |
| 32 | XXJGXX | 大宗交易价格下限 2 | N | 9,3 | |
| 33 | XXZHBL | 债券折合比例 | N | 5,2 | |
| 34 | XXDBZSL | 担保物折算率 | N | 5,2 | |
| 35 | XXRZBD | 融资标的标志 | C | 1 | |
| 36 | XXRQBD | 融券标的标志 | С | 1 | |
| 37 | XXCFBZ | 成份股标志 | С | 1 | |
| 38 | XXZSBZ | 做市商标志 | C | 1 | |
| 39 | XXSCDM | 所属市场代码 | С | 2 | 预留 |
| 40 | XXZQLB | 证券类别 | С | 4 | CFICode, 预留 |
| 41 | XXZQJB | 证券级别 | C | 1 | |
| 42 | XXZQZT | 证券状态 | C | 1 | |
| 43 | XXJYLX | 交易类型 | С | 1 | |
| 44 | XXJYJD | 产品交易阶段 | С | 1 | |
| 45 | XXTPBZ | 暂停交易标志 | С | 1 | |
| 46 | XXRZZT | 融资交易状态 | С | 1 | |
| 47 | XXRQZT | 融券交易状态 | С | 1 | |
| 48 | XXRQJX | 融券卖出价格限制 | С | 1 | |
| 49 | XXWLTP | 网络投票标志 | С | 1 | |
| 50 | XXYWZT | 其他业务状态 | С | 8 | |
| 51 | XXGXSJ | 记录更新时间 | С | 6 | HHMMSS |
| 52 | XXMARK | 备用字段 | С | 12 | 预留 |
| 53 | XXBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |



- (1) 本库中记录的一些字段在交易时段内可能实时发生变化,如证券简称前缀、产品交易阶段、暂停交易标志、融资交易状态、融券交易状态、其他业务状态、记录更新时间等。接口文件最近更新的时间揭示在 SJSHQ.dbf 首条记录的 HQBSL5 字段。
- (2) 第一条记录为特殊记录, **XXZQDM**(字段1:证券代码)为"000000", **XXZQJC**(字段2:证券简称)存放当前日期 CCYYMMDD, **XXBLDW**(字段20:买数量单位)存放库最近更新时间, **XXSLDW**(字段21:卖数量单位)存放当日挂牌证券的数量。
- (3) **XXZQDM**(字段1:证券代码)为关键字,最左两位作为证券种类标识码(见表1-2),其中首位标识证券大类,第二位标识该大类下的衍生证券,证券代码的后四位为顺序码。

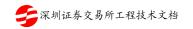
| 第一位 | 第二位 | 定义 |
|-----|-----|---------------------|
| | 0 | A股证券 |
| 0 | 3 | A 股认购或认沽权证(注1) |
| | 7 | A股增发 |
| | 8 | A股配股权证 |
| | 0 | 国债现货 |
| | 1 | 债券(注2) |
| | 2 | 可转换债券 |
| 1 | 3 | 债券回购 |
| | 5 | 开放式基金 (注3) |
| | 6 | 开放式基金 (注3) |
| | 8 | 证券投资基金 |
| 2 | 0 | B股证券 |
| 2 | 8 | B股权证 |
| | 0 | 创业板证券 |
| | 6 | 网络投票证券 (注 4) |
| 3 | 7 | 创业板增发 |
| | 8 | 创业板权证 |
| | 9 | 综合或成份指数/成交量统计指标(注5) |

证券类别定义表 (表1-2)

注 1: 其中,【030000,032999】是认购权证代码区间;【038000,039999】 是 A 股认沽权证代码区间;【033000,037999】为权证业务预留的代码区间;

注 2: 其中,【115000,115999】是分离交易型可转债的证券代码区间;

注 3: 其中, XXZQJB 字段值为'L'的, 是上市开放式基金(LOF); XXZQJB 字段值为'E'的是交易型开放式指数基金(ETF), ETF 基金代码区间为



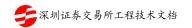
【159900, 159999】; XXZQJB 字段值为'F'的是非交易型开放式基金(暂不交易, 仅揭示基金净值及开放申购赎回业务); XXZQJB 字段值为'O'的是净值揭示服务开放式基金; 'B'协议转让即时成交确认证券。

注 4: 其中,369999 为用于投资者服务密码激活/挂失处理的专用证券; 注 5: 其中,代码以395 开头的证券用于揭示成交量统计指标。

(4) **XXJCQZ**(字段 3: 证券简称前缀)左起第一位用来表示证券是否暂停交易,第二位用来表示融资融券业务状态,第三位用来表示新股状态和除权除息状态,第四位用来表示证券类型。

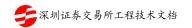
证券简称前缀定义表 (表 1-3)

| | 取值 | 定义 |
|-------------|----|------------------------------|
| | Y | 整天停牌(不接受申报) |
| 第一位 | Н | 暂停交易 (接受申报和可撤单) |
| | • | 正常交易 (注意是英文小数点字符) |
| | С | 仅可融资 |
| 然っ ル | S | 仅可融券 |
| 第二位 | A | 既可融资也可融券 |
| | • | 其他 (注意是英文小数点字符) |
| | NI | 股票: 新股上市首日 |
| | N | 可转债、权证、基金、国债、企业债等单独的证券新上市首日 |
| | M | 恢复上市首日 |
| | I | 当前证券处于发行期间 |
| | J | 公司再融资(包括增发、配股、可转债发行等)通过交易系统 |
| | J | 公开发行申购期间(仅A、B股标记,以基础证券为准) |
| 第三位 | | 股票、债券、基金: 除权除息 |
| ヤーゼ | X | 权证: 行权价格、行权比例调整起始生效日 |
| | _ | 可转债: 可转债派息除息日 |
| | | 权证: 当日可行权 |
| | W | 可转债、分离交易可转债分离出的公司债: 当日可回售或赎回 |
| | | 股票: 当日可申报预受要约 |
| | V | 当日可网络投票 (A、B 股分别标识) |
| | • | 通常状态 (注意是英文小数点字符) |
| | A | 上市公司于交易日下午收市前通过指定网站发布公告提示 |
| | С | 封闭式基金 |
| | O | 开放式基金 (仅揭示净值) |
| 第四位 | F | 非交易型基金(仅揭示基金净值及开放申购赎回业务) |
| | L | 上市开放式基金 (可交易) |
| | Е | ETF 基金 |
| | | 其他 (注意是英文小数点字符) |



注: 同一位中不同业务同时发生的,按优先次序(表中列出次序)揭示。交易所可视业务需要改变优先次序。

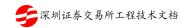
- (5) XXYWJC (字段 4: 英文简称)。对于认购或认沽权证,英文简称字段格式为"NNNNNNSYYMMDDEYYMMDD",其中左六位为标的证券代码,中间的 YYMMDD 表示权证行权起始日,最右边的 6 位 YYMMDD 表示权证行权截止日。标的证券代码、行权起始日之间以"S"为间隔符,如果间隔符"S"后面为六位空格字符串,表示对应权证的行权起始日尚未确定或尚未被触发;行权起始日、行权截止日之间以"E"为间隔符,如果间隔符"E"后面为六位空格字符串,表示对应 权 证 的 行 权 截 止 日 尚 未 确 定 或 尚 未 被 触 发 。 例 如 英 文 简 称"000001\$050628E050828"表示权证的标的证券代码是 000001,行权起始日是 2005年 6月 28日,行权截止日是 2005年 8月 28日。
- (6) **XXJCZQ**(字段 5: 基础证券),对权证,存放其标的证券代码;对可转债,存放其标的证券代码;对 ETF,存放其跟踪指数代码;对配股和增发,存放其正股代码;对于国债挂牌分销代码,存放对应国债代码。
- (7) **XXISIN**(字段 6: ISIN 编码),为证券的 ISIN 编码,编码遵循我国国家标准《证券及相关金融工具国际证券识别编码体系》。
- (8) XXHYZL(字段 7: 行业种类),对于股票,左边第一位为字母,其余两位为数字或空格,具体定义请参见中国证监会颁布的《上市公司行业分类指引》的大类划分。对于认购或认沽权证,最左边的第1位字符代表权证类别,其中"C"表示认购权证,"P"表示认沽权证;中间1位字符代表权证行权方式,其中"A"表示美式权证行权、"E"表示欧式权证行权、"B"表示百慕大式权证行权;最后1位字符代表权证结算方式,其中"C"表示现金结算方式,"S"表示证券给付结算方式。
 - (9) **XXHBZL** (字段 8: 货币种类), '00'人民币, '01'港币, '02'美元。
- (10) **XXMGMZ**(字段 9: 每股面值)。对于认购或认沽权证,存放每百份权证的行权比例值,即表示权证行权时每 100 份权证对等的标的证券的数量。
- (11) **XXSNLR**(字段 12: 上年每股利润),对于股票,存放上年每股利润;对于债券类,存放债券票面年利率;对于基金(含封闭式基金和开放式基金),存放每基金单位净资产值;对附息和零息国债,存放票面年利率;对贴现国债,存放贴现发行价;对于认购或认沽权证,存放每份标的证券的行权价格。



- (12) **XXBNLR**(字段 13: 本年每股利润),对于国债,存放每百元应计利息额;对于采用现金结算的认购或认沽权证,存放每份标的证券的结算价格。
- (13) **XXJSFL**(字段 15: 经手费率),为交易所本身或代为向投资者收取的交易费用的费率(包含证券交易规费、交易经手费等)乘以 100,即字段值除以 100 后为实际经手费率。
- (14) **XXGHFL**(字段 17: 过户费率),创业板按每笔成交股份面值计算, B股按成交金额计算。
- (15) **XXSSRQ**(字段 18: 上市日期)与 **XXDJRQ**(字段 20: 到期/交割日)的日期格式为 **CCYYMMDD**。对于债券等固定收益类产品,**XXQXRQ**(字段 19: 上市日期)为发行起息日或本次付息起息日,**XXDJRQ**(字段 20: 到期日/交割日)存放该证券到期日。
- (16) XXJYDW (字段 21: 交易单位),指接口库 SJSWT.dbf(委托库)中 WTWTSL(委托数量)的单位量,即最终的委托量=(SJSXX.XXJYDW*SJSWT.WTWTSL)。例如某证券的 SJSXX.XXJYDW=10(股),SJSWT.WTWTSL=1000,则该证券的委托量=SJSWT.WTWTSL*SJSXX.XXJYDW=10000股。
- (17) 每笔买委托的 **SJSWT.WTWTSL**(委托库字段 14: 委托数量)必须 是 **XXBLDW**(字段 21: 买数量单位)的整数倍。
- (18) 每笔卖委托的 **SJSWT.WTWTSL**(委托库字段 14: 委托数量) 必须 是 **XXSLDW**(字段 22: 卖数量单位)的整数倍。
- (19) **XXMBXL**(字段 24: 每笔限量)指 **SJSWT.WTWTSL**(委托数量)的上限。
- (20) **XXJGDW**(字段 25: 价格档位)为 **SJSWT.WTWTJG**(委托价格)的最小变动单位,例如 0.01 元 RMB。
- (21) XXJHCS(字段 26: 集合竞价限价参数)。如 XXJHCS>0,则集合竞价的有效竞价范围为: [MAX (XXJGDW , SJSHQ.HQZRSP-((SJSHQ.HQZRSP-1)*XXXJXZ+1)*XXJHCS), SJSHQ.HQZRSP+((SJSHQ.HQZRSP-1)*XXXJXZ+1)*XXJHCS]

如该证券同时设有涨跌幅限制,则取上述范围与涨跌幅限价范围的交集。在此范围内的委托才有资格参加集合竞价。

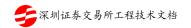
(22) **XXLXCS** (字段 27: 连续竞价限价参数)。如 **XXLXCS**>0,则连续



竞价的有效竞价范围为: [MAX (XXJGDW , SJSHQ.HQZJCJ-((SJSHQ.HQZJCJ-1) *XXXJXZ+1) *XXLXCS), SJSHQ.HQZJCJ+((SJSHQ.HQZJCJ-1)*XXXJXZ+1)*XXLXCS], 如 STSHQ.HQZJCJ 值为 0,则用 SJSHQ.HQZRSP 替代。

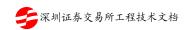
如该证券同时设有涨跌幅限制,则取上述范围与涨跌幅限价范围的交集。价格在此范围内的委托才有资格参加当时的连续竞价。

- (23) XXXJXZ(字段 28: 限价参数性质)。0 表示 XXJHCS 和 XXLXCS 的值为价格; 1表示 XXJHCS 和 XXLXCS 的值为比例数。
- (24) **XXZTJG**(字段 29: 涨停价格)为涨跌幅限制的价格上限,如果 **XXZTJG**=99999.999,则相应的证券没有涨幅限制; **XXDTJG** (字段 30: 跌停价格)为涨跌幅限制的价格下限,如果 **XXDTJG=0**,则相应的证券没有跌幅限制。
- (25) **XXJGSX**(字段 31: 大宗交易价格上限 2) 和 **XXJGXX**(字段 32: 大宗交易价格下限 2), 适用于无涨跌幅限制证券大宗交易的成交价格限制。
- (26) **XXZHBL**(字段 33:债券折合比例)。对国债现券,表示该种国债折合成 131990 综合券的比例;对企业债券,表示该种企业债折合成 131991 综合券的比例。
- (27) **XXDBZSL**(字段 34: 担保物折算率)。值大于 0 时,表示该证券属融资融券业务可充抵保证金证券,其值为折算率;值等于 0 时,表示该证券不可作为融资融券业务充抵保证金的证券。
- (28) **XXRZBD**(字段 35: 融资标的标志)。'T'表示是融资标的证券,'F' 表示不是融资标的证券。
- (29) **XXRQBD**(字段 36: 融券标的标志)。'T'表示是融券标的证券,'F' 表示不是融券标的证券。
- (30) **XXCFBZ**(字段 37: 成份股标志), 'Y'表示该证券为深证成份指数的成份股; 'T'表示该证券为深证成份指数的成份股, 但暂不纳入指数计算; 'Z'表示该证券为非成份股, 但纳入综合指数计算; 'N'其它。
- (31) **XXZSBZ**(字段 38: 做市商标志), 'T'表示该证券有做市商; 'F'表示无做市商。
- (32) **XXZQJB**(字段 41: 证券级别), 'N'Normal; 'S'ST 股票; '*'*ST 股票; 'P'股份转让; 'L' 上市开放基金 LOF; 'E' 交易型开放式指数基金 (ETF);



'F'非交易型开放式基金(暂不交易,仅揭示基金净值及开放申购赎回业务); 'O' 仅提供净值揭示服务的开放式基金。

- (33) **XXZQZT**(字段 42: 证券状态), 'N'表示通常状态; 'Y'首日上市, 'Z'增发股份上市; 'F'证券上网定价发行, 'I'证券上网竞价发行, 'P'国债挂牌分 销; 'E'表示除权, 'D'表示除息, 'A'表示除权除息。
- (34) **XXJYLX**(字段 43: 交易类型), 'G'表示集中竞价交易; 'N'表示集中竞价交易+协议交易; 'O'表示完全协议转让(标准的场外交易); ',表示其他类型(如非交易类证券)。
- (35) **XXJJZT**(字段 44: 产品交易阶段),对于交易类型为'G'或'N'的证券,'0'表示尚未开市,'1'表示处于开盘集合竞价阶段,'2'表示处于连续竞价阶段,'3'表示处于盘中临时停市,'4'表示处于收盘集合竞价阶段,'5'表示处于协议成交确认阶段,'6'表示个股闭市。
- (36) **XXTPBZ**(字段 45: 暂停交易标志), 'Y'表示长期停牌状态(停牌 n 天, n 大于等于 1), 当日交易主机不接收该证券的委托申报; 'H'表示暂停交易状态, 交易主机接收该证券的委托申报, 也可撤销申报, 但不进行竞价撮合处理, 可在开市期间恢复交易; ''表示正常交易状态。在开盘前停牌一小时或盘中临时停牌一段时间等情形下,该标志被及时更新。
- (37) **XXRZZT**(字段 46: 融资交易状态), 'T'表示当前允许融资交易, 'F' 表示暂停融资交易。
- (38) **XXRQZT**(字段 47: 融券交易状态), 'T'表示当前允许融券交易, 'F' 表示暂停融券交易。
- (39) **XXRQJX**(字段 48: 融券卖出价格限制), '0'对融券卖出委托价格不限制; '1'要求融券卖出申报价格不低于最近价; '2'要求融券卖出申报价格不低于昨收价。
- (40) **XXWLTP**(字段 49: 网络投票标志), 'T'表示该证券对应的上市公司当日有交易系统网络投票, 'F'表示对应上市公司当日无交易系统网络投票。
- (41) **XXYWZT**(字段 50: 其他业务状态), 左边起第一位至第四位的含义见下表, 其他四位预留。



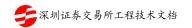
其他业务状态定义表 (表 1-4)

| | 股票 | 开放式基金 (LOF 和 ETF) | 可转债 | 权证 | 其他种类 |
|-----|---|-------------------------------|---|---|------------------|
| 第一位 | 'T':处于要约 收购期;'F':不处于要 约收购期 | | 'T': 处于转股/ 回售期;'F': 不处于转股/ 回售期 | 期; | 无实际意义,固 定为'T' |
| 第二位 | | 'T': 当前允许 申购; 'F': 暂停申购 | 'T': 当前允许转 股; 'F': 暂停转股 | 'T': 当前允许 行权; 'F': 暂停行权 | 无实际意义,固定为'T' |
| 第三位 | | 'T': 当前允许 赎回; 'F': 暂停赎回 | 'T': 当前允许回 售; 'F': 暂停回售 | 'T': 当日有权 证实时创设; 'F': 当日无权 证实时创设 | 无实际意义,固 定为'T' |
| 第四位 | 'T': 已完成股 改或已全流通; 'F': 未完成股 改 | | | (T': 当日有权 证实时注销; (F': 当日无权 证实时注销 | 无实际意义,固 定为'T' |

(42) **XXGXSJ**(字段 51: 记录更新时间), 存放每条记录最新的更新时间, 格式为 HHMMSS。

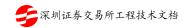
3. 行情库 SJSHQ.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|----|
| 1 | HQZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 2 | HQZQJC | 证券简称 | C | 8 | |
| 3 | HQZRSP | 昨日收盘价 | N | 9,3 | |
| 4 | HQJRKP | 今日开盘价 | N | 9,3 | |
| 5 | HQZJCJ | 最近成交价 | N | 9,3 | |
| 6 | HQCJSL | 成交数量 | N | 12,0 | |
| 7 | HQCJJE | 成交金额 | N | 17,3 | |
| 8 | HQCJBS | 成交笔数 | N | 9,0 | |
| 9 | HQZGCJ | 最高成交价 | N | 9,3 | |
| 10 | HQZDCJ | 最低成交价 | N | 9,3 | |
| 11 | HQSYL1 | 市盈率1 | N | 7,2 | |
| 12 | HQSYL2 | 市盈率 2 | N | 7,2 | |
| 13 | HQJSD1 | 价格升跌 1 | N | 9,3 | |
| 14 | HQJSD2 | 价格升跌 2 | N | 9,3 | |
| 15 | НОНУСС | 合约持仓量 | N | 12,0 | |
| 16 | HQSJW5 | 卖价位五 | N | 9,3 | |
| 17 | HQSSL5 | 卖数量五 | N | 12,0 | |
| 18 | HQSJW4 | 卖价位四 | N | 9,3 | |
| 19 | HQSSL4 | 卖数量四 | N | 12,0 | |
| 20 | HQSJW3 | 卖价位三 | N | 9,3 | |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------------|----|------|----|
| 21 | HQSSL3 | 卖数量三 | N | 12,0 | |
| 22 | HQSJW2 | 卖价位二 | N | 9,3 | |
| 23 | HQSSL2 | 卖数量二 | N | 12,0 | |
| 24 | HQSJW1 | 卖价位一/叫卖揭示价 | N | 9,3 | |
| 25 | HQSSL1 | 卖数量一 | N | 12,0 | |
| 26 | HQBJW1 | 买价位一/叫买揭示价 | N | 9,3 | |
| 27 | HQBSL1 | 买数量一 | N | 12,0 | |
| 28 | HQBJW2 | 买价位二 | N | 9,3 | |
| 29 | HQBSL2 | 买数量二 | N | 12,0 | |
| 30 | HQBJW3 | 买价位三 | N | 9,3 | |
| 31 | HQBSL3 | 买数量三 | N | 12,0 | |
| 32 | HQBJW4 | 买价位四 | N | 9,3 | |
| 33 | HQBSL4 | 买数量四 | N | 12,0 | |
| 34 | HQBJW5 | 买价位五 | N | 9,3 | |
| 35 | HQBSL5 | 买数量五 | N | 12,0 | |

- (1) 每个交易日本库的第一条记录为特殊记录,HQZQDM 为"000000",HQZQJC 存放当前日期 CCYYMMDD,HQCJBS 存放当前时间 HHMMSS,HQZRSP 存放"指数因子",HQCJSL 存放行情状态信息。当本库的记录为指数记录时(HQZQDM 的最左两位为 39),相应的字段 HQZRSP、HQJRKP、HQZJCJ、HQZGCJ、HQZDCJ等都必须乘上该"指数因子",计算出的结果才为实际的指数值。HQCJSL 个位数存放收市行情标志(0: 非收市行情; 1: 表示收市行情),HQCJSL 十位数存放正式行情与测试行情标志(0: 正式行情; 1: 表示测试行情),即 HQCJSL 值为 0 时表示正式非收市行情,为 1 时表示正式收市行情,为 10 时表示测试的非收市行情;为 11 时表示测试的收市行情,HQBSL4存放当日最近一次发布信息公告的时间,格式为 HHMMSSss,HQBSL5 存放SJSXXN.dbf 最近一次更新的时间,格式为 HHMMSSss。
 - (2) **HQZQDM**(字段1: 证券代码)为关键字。
- (3) **HQZRSP**(字段 3: 昨日收盘价),对于净值揭示服务(XXZQJB 值为'N')的开放式基金,存放每百份基金单位净值;对于非交易型(XXZQJB 值为'F')的开放式基金,固定为 1.000 元。
- (4) **HQSYL1**(字段 11: 市盈率 1),对于国债,存放每百元国债应计利息额,该值按"4 舍 5 入"原则精确到 0.01 元,只作为行情揭示用;对于基金(含封闭式基金和开放式基金),存放每百份基金单位净值(上一交易日净值)。
 - (5) HQSYL2 (字段 12: 市盈率 2), 对于国债, 存放到期年收益率, 供



市场参考用。国债的到期年收益率采取单利计算,计算公式为: y=((FV-PV)/PV) *(365/D),其中 y 为到期收益率, PV 为债券全价(等于成交价格加应计利息), D 为交易当日至债券兑付日的实际天数, FV 为到期本息和;对于 LOF 和 ETF, 存放交易当日定时更新的每百份基金单位净值估值;对于认购或认沽权证,存放权证实时溢价率的百分比值,例如该值为 20,则表示权证实时溢价率为 20%。

- (6) **HQJSD1**(字段 13: 升跌一) = **HQZJCJ**(字段 5: 最近成交价) **HOZRSP**(字段 3: 昨收盘价)。
- (7) **HQJSD2**(字段 14: 升跌二) = **HQZJCJ**(最近成交价) 上笔成交价。

对于当天的第一笔成交: HQJSD2 (升跌二) = HQZJCJ (最近成交价) - HQZRSP (昨收盘价)。

- (8) HQHYCC (字段 15: 合约持仓量)目前未用。
- (9) 卖盘五至卖盘一(HQSJW5,HQSSL5,HQSJW4,HQSSL4,HQSJW3,HQSSL3,HQSJW2,HQSSL2,HQSJW1,HQSSL1)为实时最低五个价位卖出申报价和数量,买盘一至买盘五(HQBJW1,HQBSL1,HQBJW2,HQBSL2,HQBJW3,HQBSL3,HQBJW4,HQBSL4,HQBJW5,HQBSL5)为实时最高五个价位买入申报价和数量。

如买卖盘价格字段都不为空(都大于零),字段值有如下关系: HQSJW5>HQSJW4>HQSJW3>HQSJW2>HQSJW1 , HQBJW5<HQBJW4<HQBJW3<HQBJW2<HQBJW1.

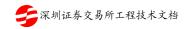
(10) 行情库中,证券代码以'395'打头的记录为成交量统计指标记录。

其中,字段 HQZQDM、HQZQJC 分别存放成交量统计指标的证券代码和简称,HQCJSL、HQCJJE、HQCJBS、HQZRSP 字段中分别存放各类别相应的成交单位数、成交金额、成交笔数、证券只数(其中 395099 记录的 HQZRSP 字段固定为1),所有成交金额的单位均为人民币。

现有统计指标如下表。

统计指标定义表 (表 1-5)

| 序号 | 证券代码 | 证券简称 | 计算口径 |
|----|--------|------|--------------------------|
| 1 | 395001 | A股证券 | 所有 A 股的成交量, 含中小盘不含沪市配售部分 |
| 2 | 395002 | B股证券 | 所有 B 股的成交量 |
| 3 | 395003 | 中小企业 | 所有中小企业板块股票的成交量 |
| 4 | 395011 | 封闭基金 | 所有封闭式基金的成交量 |
| 5 | 395012 | LOFs | 所有 LOF 的成交量,但不含非上市的部分 |



| 序号 | 证券代码 | 证券简称 | 计算口径 |
|----|--------|------|-----------------|
| 6 | 395013 | ETFs | 所有 ETF 的成交量 |
| 7 | 395021 | 可转债 | 所有可转债的成交量 |
| 8 | 395022 | 企债现券 | 所有企业债现券的成交量 |
| 9 | 395023 | 企债回购 | 所有企业债回购的成交量 |
| 10 | 395031 | 国债现券 | 所有国债现券的成交量 |
| 11 | 395032 | 国债回购 | 所有国债回购的成交量 |
| 12 | 395041 | 股票权证 | 所有以股票为标的的权证的成交量 |
| 13 | 395099 | 总成交 | 市场总成交量 |

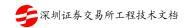
4. 指数库 SJSZS.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|----|
| 1 | ZSZSDM | 指数代码 | С | 6 | |
| 2 | ZSZSQC | 指数全称 | С | 12 | |
| 3 | ZSYWMC | 英文名称 | С | 20 | |
| 4 | ZSSSZS | 昨日收市指数 | N | 11,4 | |
| 5 | ZSKSZS | 今日开市指数 | N | 11,4 | |
| 6 | ZSZGZS | 最高指数 | N | 11,4 | |
| 7 | ZSZDZS | 最低指数 | N | 11,4 | |
| 8 | ZSZJZS | 最近指数 | N | 11,4 | |
| 9 | ZSCJSL | 成交数量 | N | 12,0 | |
| 10 | ZSCJJE | 成交金额 | N | 17,3 | |

- (1) 本库作为指数专用库,供需要的机构使用。
- (2) **ZSZSDM**(字段1: 指数代码)的编码纳入证券代码的编码体系,其最左两位值固定为39。
- (3) **ZSCJSL**(字段 9: 成交数量)和 **ZSCJJE**(字段 10: 成交金额)值均为属于该种指数样本的所有证券的"成交数量"与"成交金额"的累计值,其中 B 股类指数记录的成交金额是按当前汇率折算后的人民币值。例如 **ZSJSQC** 为"深圳综合指数"记录的该两字段值应是属于深圳综合指数样本的所有股票的累计值,而"深圳成份指数"的该两字段值只是属于成份指数样本的那些股票的累计值。

5. 委托库 SJSWT.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|-----|-------|
| 1 | WTHTXH | 合同序号 | C | 22 | |
| 2 | WTZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 3 | WTGDDM | 证券账户 | C | 10 | 数字字符串 |
| 4 | WTWTSL | 委托数量 | N | 9,0 | |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|-----|----------|
| 5 | WTWTJG | 委托价格 | N | 9,3 | |
| 6 | WTYWLB | 业务类别 | C | 2 | |
| 7 | WTWTSJ | 委托写入时间 | C | 6 | HHMMSS |
| 8 | WTCLBZ | 处理标志 | С | 1 | |
| 9 | WTMARK | 备用字段 | С | 2 | 融资融券相关标识 |
| 10 | WTBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

- (1) WTHTXH(字段1: 合同序号)左六位为表示席位代码的数字串。 其后8位为委托日期(CCYYMMDD)。右8位为委托流水号。委托流水号中最左两位(即合同序号 WTHTXH的第15、16位)可为英文字母或阿拉伯数字,其余六位为阿拉伯数字。对实施会员集中报盘的证券营业部,委托流水号的前两位(即合同序号 WTHTXH的第15、16位)即为同一会员属下的证券营业部识别码。
- (2) **WTGDDM**(字段 3: 证券账户)为十位数字字符,不足十位的左端补足'0',不可含空格。
- (3) **WTWTSL** (字段 4: 委托数量) 和 **WTWTJG** (字段 5: 委托价格) 两字段的值域要求,同 **WTYWLB** (业务类别) 有关,详见表 1-6。
- (4) 当 WTYWLB(字段 6: 业务类别)为"3S"、"AB"、"AS"、"BB"、"BS"、"CB"、"CS"、"DB"、"DS"之一时,WTWTJG(委托价格)字段存放的是对应的席位代码,存放格式如 0xxxx.xx0 ,填'x'的位置即为席位代码; 当 WTYWLB为"ES"、"FS"之一时,WTWTJG 字段存放的是对应的收购人编码,存放格式如 0xxxx.xx0 ,填'x'的位置即为收购人编码。
- (5) WTCLBZ(字段 8: 处理标志)将表明本委托记录的处理状态。其初始值由证商系统置为'z';通信程序将对该笔委托的合法性进行检查,若合法则将其传送给深交所主机,同时将 WTCLBZ 置为'1',非法则被置为对应的错误代码(见表 1-7)。
- (6) 在转托管委托中(WTYWLB='3S'),若转入方的席位代码是以'6'开头的,则表示该委托是跨系统转托管,否则是系统内的转托管委托。对于跨系统转托管委托,必须申报具体的证券代码、转托管数量;对于系统内转托管委托,则支持模糊申报方式,具体解释如下:若WTZQDM(字段2:证券代码)为空格,表示该证券账户(WTGDDM)在该席位(在WTHTXH中)下的所有证券都要求转至新的席位(在WTWTJG中);若WTWTSL=0,表示该证券账户在该席位下的该证券(WTZQDM)的全部持有量都转至转入席位。上述两种情况若有冻结股份则不执行转托管,其余情况按相关字段实际值(小于等于未冻结部分)执行转托管。
 - (7) WTMARK (字段 9: 备用字段) 原为保留字段, 现启用, 左边第一位标

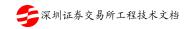


识融资融券等信息: '1': 融资, '2': 融券, 其余值: 普通(建议填 ''); 第二位标识平仓信息: '1': 开仓(预留), '2': 平仓(预留), '3': 强制平仓, 其余值: 普通交易(建议填 '')。

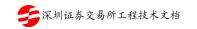
- (8) 交易系统提供网络投票服务。对于网络投票业务(挂牌证券代码为"36"+原证券代码的后四位,投票简称为"XX 投票"),投资者申报正常买指令(WTYWLB=0B)或新股申购指令(WTYWLB=7B),申购价格(1.00元的整数倍)代表股东大会议案序号,如股东大会有多个议案,则1.00元代表议案1,2.00元代表议案2(如议案2中有多个需表决的议项,2.00元代表对议案2下全部议项进行表决,投资者也可逐项表决,2.01元代表议案2中议项①,2.02元代表议案2中议项②.....),依此类推;申购数量代表表决意见,1股代表同意,2股代表反对,3股代表弃权。
- (9) 交易系统提供投资者服务密码激活/挂失服务。对于密码服务(挂牌证券代码固定为369999),投资者申报正常买指令(WTYWLB=0B)或新股申购指令(WTYWLB=7B),委托价格1.00元表示"激活密码"、2.00元表示"挂失密码";对于"激活密码"指令,委托数量填写投资者在我所网站或互联网投票系统的"密码服务专区"申请密码时系统分配的校验号码,对于"挂失密码"指令,委托数量填1股(或大于0的值)。
- (10)在开放式基金申购申报中(WTYWLB='IB'),委托数量 WTWTSL字段值表示申购金额,最小申购单位为 1 元;在开放式基金赎回申报中(WTYWLB='IS'),委托数量 WTWTSL字段值表示赎回份额。
- (11)对认购或认沽权证的行权申报记录(WTYWLB='JB'),委托数量WTWTSL 字段值填欲行权的权证数量,委托价格WTWTJG字段值填每份标的证券的行权价格;对认购或认沽权证的行权撤单委托记录(WTYWLB='JC'),委托数量WTWTSL字段值填原行权申报记录的权证数量,委托价格WTWTJG字段值填0。

| | 安化业务关州各人农(农1-0) | | |
|--------|--------------------------|---------|--------|
| WTYWLB | 委托业务含义 | WTWTSL | WTWTJG |
| 0B | 正常交易业务的买委托记录 | >0 | >0 |
| 0S | 正常交易业务的卖委托记录 | >0 | >0 |
| 0C | 正常交易业务的撤单记录 | | =0 |
| 2B | 即时成交剩余撤销买委托记录 | >0 | =0,注 |
| 2S | 即时成交剩余撤销卖委托记录 | >0 | =0,注 |
| 3S | 转托管申报记录,转出席位代码在 WTHTXH 中 | 等于0表示全额 | 存放转入席 |
| | | 转托管本证券 | 位代码 |
| 3C | 转托管业务中撤单委托记录 | | =0 |

委托业务类别含义表 (表 1-6)



| WTYWLB | 委托业务含义 | WTWTSL | WTWTJG |
|--------|----------------------------|--------|--------------|
| 4B | 配股认购业务中认购委托记录 | >0 | 配股价 |
| 4C | 配股认购业务中撤单委托记录 | | =0 |
| 5S | 可转债转股业务中转股申报记录 | >0 | =0 |
| 5C | 可转债转股业务中撤单委托记录 | | =0 |
| 6S | 可转债回售业务中回售申报记录 | >0 | =0 |
| 6C | 可转债回售业务中撤单委托记录 | | =0 |
| 7B | 新股申购业务中申购委托记录 注1 | >0 | 申购价 |
| 7C | 新股申购业务中撤单委托记录 注1 | | =0 |
| 8C | 市值配售新股发行业务中签后的放弃认购委托记录 | >0 | 0 |
| 8X | 市值配售新股发行业务中签后的放弃认购的撤单委 | | 0 |
| | 托记录 | | |
| AB | 无股份冻结质押业务中质权人的申报记录。对应出质 | >0 | 对应出质人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码, 任何 |
| AS | 无股份冻结质押业务中出质人的申报记录。对应质权 | | 对应质权人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中。若是债券转入 | | 的席位代码 |
| | 质押库的申报,则质权人席位代码固定填 999999; | | |
| | 证券代码填可做质押式回购的国债或企债代码;对于 | | |
| | 无明细债券,出质人股东代码 WTGDDM 填 | | |
| | '0088888888'。 | | |
| AC | 无股份冻结质押业务中撤单委托记录 | | =0 |
| BB | 股份质押且冻结业务中质权人的申报记录。对应出质 | >0 | 对应出质人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码 |
| BS | 股份质押且冻结业务中出质人的申报记录。对应质权 | | 对应质权人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码 |
| BC | 股份质押且冻结业务中撤单委托记录 | | =0 |
| СВ | 无股份冻结解押业务中出质人的申报记录。对应质权 | >0 | 对应质权人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中。若是债券转出 | | 的席位代码 |
| | 质押库的申报,则质权人席位代码固定填 999999; | | |
| | 证券代码填可做质押式回购的国债或企债代码;对于 | | |
| | 无明细债券,出质人股东代码 WTGDDM 填 | | |
| | '0088888888'。 | | |
| CS | 无股份冻结解押业务中质权人的申报记录。对应出质 | | 对应出质人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码 |
| CC | 无股份冻结解押业务中撤单委托记录 | | =0 |
| DB | 股份解押且解冻业务中出质人的申报记录。对应质权 | >0 | 对应质权人 |
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码 |
| DS | 股份解押且解冻业务中质权人的申报记录。对应出质 | | 对应出质人 |
| | | | |



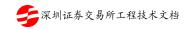
| WTYWLB | 委托业务含义 | WTWTSL | WTWTJG |
|--------|------------------------|--------|--------------------|
| | 人的席位代码须填在 WTWTJG 中 | | 的席位代码 |
| DC | 股份解押且解冻业务中撤单委托记录 | | =0 |
| ES | 流通股份要约收购业务中的预受要约申报记录 | >0 | 存放收购人 |
| | | | 编码 |
| EC | 流通股份要约收购业务中的预受要约撤单委托记录 | | =0 |
| FS | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约申报记录 | >0 | 存放收购人 |
| | | | 编码 |
| FC | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约撤单委托 | | =0 |
| | 记录 | | |
| IB | 开放式基金申购申报记录 | 申购金额 | =0 |
| IS | 开放式基金赎回申报记录 | 赎回份额 | =0 |
| IC | 开放式基金申购、赎回业务的撤单委托记录 | | =0 |
| JB | 认购或认沽权证的行权申报记录 | >0 | 行权价格 |
| JC | 认购或认沽权证的行权撤单委托记录 | | =0 |
| KB | ETF基金申购申报记录 | >0 | =0, 注 ² |
| KS | ETF基金赎回申报记录 | >0 | =0, 注 ² |
| VB | 最优五档即时成交剩余撤销买委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| VS | 最优五档即时成交剩余撤销卖委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| WB | 全额成交或撤销买委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| WS | 全额成交或撤销卖委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| XB | 本方最优价格买委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| XS | 本方最优价格卖委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| XC | 本方最优价格撤单委托记录 | | =0 |
| YB | 对手方最优价格买委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| YS | 对手方最优价格卖委托记录 | >0 | =0, 注 ² |
| YC | 对手方最优价格撤单委托记录 | | =0 |

注1: 此处"新股申购"业务,包括股票等证券的发行(含增发)业务。

注²: 此处委托价格(WTWTJG)字段无实际意义,可填任意值。

委托记录错误代码含义表 (表 1-7)

| 错误代码 | 含义 |
|------|--|
| A | 席位代码非法 |
| В | 委托日期非法 |
| D | 证券代码非法 |
| Е | 证券停牌 |
| F | 买委托数量不是 SJSXX.XXBLDW 的整数倍;或 卖委托数量不是 SJSXX.XXSLDW 的整数倍;或 委托数量超出 SJSXX.XXMBXL 的限值; |

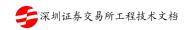


| 错误代码 | 含义 |
|------|--------------------------|
| G | 委托价格不是 SJSXX.XXJGDW 的整数倍 |
| Н | 证券账户含有非数字字符 |
| I | 非法的委托业务 |
| J | 测试环境正式用户不允许报单 |
| K | WTCLBZ 没有填'z' |
| L | 交易期间测试用户不允许报单 |
| M | 该席位无权经营该种证券 |
| N | 该证券账户无权交易该种证券 |
| P | 该证券在当前时间不可交易 |
| Q | 席位被禁买或禁卖 |
| R | 证券账户被禁买或禁卖 |
| W | 席位资金可用量不足 |
| X | 该委托记录标有 DELETE 标记 |

6. 回报库 SJSHB.dbf

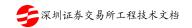
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|-----|----------|
| 1 | НВСЈНМ | 成交号码 | С | 8 | 数字字符串 |
| 2 | HBZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 3 | нвнтхн | 合同序号 | C | 22 | |
| 4 | HBGDDM | 证券账户 | C | 10 | 数字字符串 |
| 5 | HBCJSL | 成交数量 | N | 9,0 | |
| 6 | HBCJJG | 成交价格 | N | 9,3 | |
| 7 | HBDFXW | 对方席位 | C | 6 | 数字字符串 |
| 8 | HBDFGD | 对方股东 | C | 10 | 数字字符串 |
| 9 | HBCJSJ | 成交时间 | C | 8 | HHMMSSCC |
| 10 | HBCJRQ | 成交日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 11 | HBYWLB | 业务类别 | C | 2 | |
| 12 | HBCDYY | 撤单原因 | C | 2 | |
| 13 | HBMARK | 备用字段 | С | 2 | 融资融券相关标识 |
| 14 | HBBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) HBCJHM(字段1: 成交号码)是本所交易主机当日产生的成交流水号。
- (2) **HBCJSL** (字段 5: 成交数量) 和 **HBCJJG** (字段 6: 成交价格) 两字段的值域要求,同 **HBYWLB** (字段 11: 业务类别) 有关,详见表 1-8。



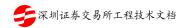
回报业务类别含义表 (表 1-8)

| HBYWLB | 交易回报业务含义 | HBCJSL | HBCJJG |
|--------|------------------------|---------|--------|
| 0B | 交易业务买成交记录 | >0 | 成交价 |
| 0S | 交易业务卖成交记录 | >0 | 成交价 |
| 0C | 交易业务撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| 1B | B股对敲或大宗交易的买成交记录 | >0 | 成交价 |
| 1S | B股对敲或大宗交易的卖成交记录 | >0 | 成交价 |
| 2C | "即时成交剩余撤销委托"未能成交部分或其他原 | <0 | =0 |
| | 因的自动撤单回报记录 | | |
| 38 | 转托管申报被接受的回应记录,转入席位代码在 | ≥0 | =0 |
| | HBDFXW 中。 | | |
| 3C | 转托管业务撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| 4B | 配股认购委托被接受的回应记录 | >0 | 配股价 |
| 4C | 配股认购业务撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| 5S | 可转债转股申报被接受的回应记录 | >0 | =0 |
| 5C | 可转债转股业务撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| 6S | 可转债回售申报被接受的回应记录 | >0 | =0 |
| 6C | 可转债回售业务撤单回报记录 ≤0 | | =0 |
| 7B | 新股申购业务申购回报记录 | >0 | 申购价 |
| 7C | 新股申购业务撤单回报记录 | 0 或原委托量 | =0 |
| 9B | 国债回购到期反向成交的买方记录 | >0 | 回购竞价 |
| 9S | 国债回购到期反向成交的卖方记录 | | |
| AB | 无股份冻结质押业务中质权人申报被接受的回应 | >0 | =0 |
| | 记录。出质人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| AS | 无股份冻结质押业务中出质人申报被接受的回应 | >0 | |
| | 记录。质权人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| AC | 无股份冻结质押业务撤单回报记录 | ≤0 | |
| BB | 股份质押且冻结业务中质权人申报被接受的回应 | >0 | =0 |
| | 记录。出质人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| BS | 股份质押且冻结业务中出质人申报被接受的回应 | >0 | |
| | 记录。质权人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| BC | 股份质押且冻结业务撤单回报记录 | ≤0 | |
| СВ | 无股份冻结解押业务中出质人申报被接受的回应 | >0 | =0 |
| | 记录。质权人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| CS | 无股份冻结解押业务中质权人申报被接受的回应 | >0 | |
| | 记录。出质人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| CC | 无股份冻结解押业务撤单回报记录 | ≤0 | |
| DB | 股份解押且解冻业务中出质人申报被接受的回应 | >0 | =0 |
| | 记录。质权人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| DS | 股份解押且解冻业务中质权人申报被接受的回应 | >0 | =0 |



| HBYWLB | 交易回报业务含义 | HBCJSL | HBCJJG |
|--------|-------------------------|--------|--------|
| | 记录。出质人席位代码在 HBDFXW 中。 | | |
| DC | 股份解押且解冻业务撤单回报记录 | ≤0 | |
| ES | 流通股份要约收购业务中的预受要约申报被接受 | >0 | =0 |
| | 的回应记录 | | |
| EC | 流通股份要约收购业务中的预受要约撤单回报记 | ≤0 | |
| | 录 | | |
| FS | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约申报被 | >0 | =0 |
| | 接受的回应记录 | | |
| FC | 流通股份要约收购业务中的解除预受要约撤单回 | ≤0 | |
| | 报记录 | | |
| GB | 流通股份协议收购业务中的买成交记录 | >0 | 协议收购价 |
| GS | 流通股份协议收购业务中的卖成交记录 | >0 | 协议收购价 |
| IB | 开放式基金申购申报被接受的回应记录 | >0 | =0 |
| IS | 开放式基金赎回申报被接受的回应记录 | >0 | =0 |
| IC | 开放式基金申购/赎回业务的撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| JB | 认购或认沽权证的行权申报被接受的回应记录 | >0 | 行权价 |
| JC | 认购或认沽权证行权业务的撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| KB | ETF基金申购成功回报记录或 | >0 | =0 |
| | ETF 基金赎回成功证券给付明细回报记录 | | |
| KS | ETF 基金申购成功股份交付明细记录或 | >0 | =0 |
| | ETF基金赎回成功回报记录 | | |
| KC | ETF基金申购/赎回撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| VC | "最优五档即时成交剩余撤销委托"未能成交部分 | <0 | =0 |
| | 的自动撤单或其他原因的自动撤单回报记录 | | |
| WC | "全额成交或撤销委托"未能成交时的自动撤单或 | <0 | =0 |
| | 其他原因自动撤单回报记录 | | |
| XC | 本方最优价格委托的撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| YC | 对手方最优价格委托的撤单回报记录 | ≤0 | =0 |
| ZB | ETF 基金申购成功允许现金替代明细回报记录或 | >0 | >0 |
| | ETF 基金申购成功必须现金替代明细回报记录 | | |
| ZS | ETF 基金赎回成功必须现金替代证券的现金给付 | >0 | >0 |
| | 明细记录 | | |

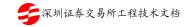
- 注: 表中列出的撤单回报记录包含主动撤单和系统自动撤单两类。前者是回应客户的撤单要求而返回的撤单回报记录,后者是对本所交易主机检查出的非法 委托返回的撤单回报记录。
- (3) **HBZQDM**(字段 2: 证券代码)、**HBHTXH**(字段 3: 合同序号)和 **HBGDDM**(字段 4: 证券账户)的定义同委托库(**SJSWT.dbf**),其值与相应委托记录对应相等。



- (4) **HBDFXW**(字段 7: 对方席位)和 **HBDFGD**(字段 8: 对方股东)为交易业务中的成交对手方。在转托管业务中,**HBDFXW** 为转入席位代码;在流通股份要约收购业务中,**HBDFXW** 为收购人编码;在债券质押式回购相应的债券转入、转出质押库的业务(**HBYWLB** 为'AS'或'CB')中,**HBDFXW** 固定为999999。
- (5) **HBCJSL<0** 表示成功撤单的回报(|**HBCJSL**|是被撤单的股数); **HBCJSL=0**则表示撤单不成功的回报。
- (6) 集中竞价市场闭市标志: **HBCJJG** = -2.000; 全天市场闭市标志: **HBCJJG** = -3.000。
- (7) **HBCDYY**(字段 12: 撤单原因)为本所交易主机对委托自动撤单的原因代号,其含义见表 1-9,相应撤单原因简要说明填于 **HBDFGD**(字段 8: 对方股东)。

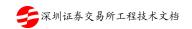
| 亦易 | 主机 | 白动 | 描单 | 今义 | 去 (| 善 | 1.0 | ١ |
|----|----|------|-------|-------|-------|-------|-------|---|
| 又勿 | エル | E 49 | 111队一 | ~ ~ ~ | .A. I | · 185 | ユーフ ノ | , |

| HBCDYY | HBDFGD | 具体含义 |
|--------|--------|-------------------------|
| 01 | 无效账户 | 证券账户无效 |
| 02 | 回购卖空 | 席位拥有的回购虚拟券数量小于卖出委托数量 |
| 03 | 席位卖空 | 席位拥有的该证券可用股数小于卖出或赎回委托数量 |
| 04 | 股东卖空 | 股东拥有的该证券可用股数小于卖出或赎回委托数量 |
| | | 证券公司融券专户上可用股数小于融券卖出委托数量 |
| 05 | 总量超限 | 国债挂牌分销,账户买入量总和超过每账户的限制 |
| 06 | 价格过高 | 交易申报价格超出涨跌幅的上限 |
| 07 | 价格过低 | 交易申报价格超出涨跌幅的下限 |
| 08 | 价格错误 | 新股定价发行, 申报价不等于发行价或 |
| | | 新股竞价发行,申报价超出限价范围或 |
| | | 国债挂牌分销,申报价不等于分销价或 |
| | | 配股认购的申报价不等于配股价 |
| | | 融券卖出价格低于规定价格 |
| 09 | 数量非法 | 申购量非申购单位的整数倍 |
| | | 开放式基金申购金额或赎回份额小于最低数额限制 |
| 10 | 数量超限 | 新股申购量超过最大可申购量或 |
| | | 国债挂牌分销买入量超过每笔委托申报数量限制或 |
| | | 国债挂牌分销卖方累计挂牌量超过注册量 |
| 11 | 重复申购 | 新股发行中同一证券账户重复申购 |
| 12 | 账户非法 | 国债分销商不能用托管账户自买 |
| 13 | 转股禁止 | 当天禁止该可转换债券的转股业务 |
| 14 | 回售禁止 | 当天禁止该可转换债券的回售业务 |
| 15 | 非质押物 | 该证券不能作为质押物 |
| 16 | 持股超限 | 单个或一类证券账户拥有某证券的股份数量超过限制 |
| 23 | 无效席位 | 该席位无权经营该业务 |



| HBCDYY | HBDFGD | 具体含义 |
|--------|--------|----------------------------|
| | | 该席位融资/融券业务权限被暂停或 |
| | | 信用证券账户不能在普通席位上进行交易 |
| 24 | 申购禁止 | 当天禁止该开放式基金的申购业务 |
| 25 | 赎回禁止 | 当天禁止该开放式基金的赎回业务 |
| 31 | 行权禁止 | 当天禁止该认购或认沽权证的行权业务 |
| 32 | ETF 申禁 | 当前禁止该 ETF 的申购业务 |
| 33 | ETF 赎禁 | 当前禁止该 ETF 的赎回业务 |
| 35 | 申购不足 | 申购所需的组合证券份额不足 |
| 36 | 赎回不足 | 赎回时基金公司的组合证券份额不足 |
| 37 | 现金超限 | ETF 申购时现金替代比例超限 |
| 42 | 融资禁止 | 当前禁止该证券的融资交易业务 |
| 43 | 融券禁止 | 当前禁止该证券的融券交易业务 |
| 44 | 无效业务 | 无效业务类别 |
| 45 | 买卖禁止 | 当天禁止该证券买卖业务(如 ETF 只开放申购赎回) |
| 99 | 其他错误 | 因其他原因导致的交易主机自动撤单 |

- (8) HBMARK(字段 13: 备用字段)原为保留字段,现启用。左边第一位标识融资融券等信息: '1': 融资, '2': 融券, ''(空格): 普通; 第二位标识平仓信息: '1': 开仓(预留), '2': 平仓(预留), '3': 强制平仓, ''(空格): 普通交易。
- (9) 对于债券回购,当天的每一笔交易,在回报库 SJSHB.DBF 中有两笔连续存放的回报记录: 第 1 笔是初始交易成交,成交价格为 100.000,成交数量为实际的回购量,买卖方向与原委托的买卖方向相反; 第 2 笔为到期交易信息,用于告知该笔交易的到期回购年利率,其成交价格为竞出的回购年利率,成交数量为 0, 成交时间字段填回购到期日期,买卖方向与原委托相同,与第 1 笔相反(如第 1 笔 HBYWLB 为"0B",则第 2 笔为"0S")。在回购到期日,交易所系统自动回报一条回购到期反向成交记录到回报库 SJSHB.DBF,其成交数量为当初实际的回购量,成交价格为当初竞出的回购年利率,业务类别 HBYWLB 为"9S"或"9B"。



二、 信息公告接口规范

本部分接口规范描述了通过深交所行情系统发送的信息公告文件接口。信息公告文件为文本格式,一个信息公告就是单独的一个文本。

为方便及时获取最新公告信息,SJSHQ.dbf 首条特殊记录的 HQBSL4 字段记录了最新公告信息的接收时间(即当日最近一次收到信息公告的时间)。

7. 信息公告文件 xxyymmdd.nnn

信息公告文件的命名规则

不同的文件名前缀用来区分不同类型的信息公告。信息公告文件的命名规则为:文件名 xxyymmdd.nnn=类型前缀+公告日期+ "."+流水号后缀。

其中,类型前缀 "XX" 表示信息类型为 "信息公告"; 类型前缀 "GS" 表示信息类型为 "上市公司信息"; 类型前缀 "GG" 表示信息类型为 "紧急公告"。

日期为不含世纪的 6 位数字,格式为 yymmdd,其中 yy 表示年,mm 表示月,dd 表示日。

流水号后缀号为3位数字,每天顺序编写。

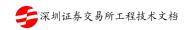
文件名相同的信息公告下发时,应当重新读取新文件内容,取代旧文件内容。

| 序号 | 文件名 | 信息类型 | 备注 |
|----|--------------|---------|---|
| 1 | XXyymmdd.nnn | 交易所信息公告 | yymmdd 为公告日期, nnn 为文件编号 信息内容包括:交易所业务通知和公告、交易公 开信息、网络投票提示等信息 |
| 2 | GSyymmdd.nnn | 上市公司信息 | yymmdd 为公告日期, nnn 为文件编号 内容包括:深市上市公司信息摘要、基金上网发 行提示等信息 |
| 3 | GGyymmdd.nnn | 交易所紧急公告 | Yymmdd 为公告日期, nnn 为文件编号 内容包括:交易所紧急公告、上市证券临时停牌 公告等信息 |

信息公告文件命名示例 (表 2-1)

信息公告文件的结构头

信息公告文本包含有一个带格式的结构头,结构头存放了信息公告的发送日期、发送时间、信息类型、主标题、主题词等要素。具体约定见表 2-2。



信息公告文件头结构定义 (表 2-2)

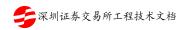
| 序号 | 要素 | 格式 | 备注 |
|----|------|----------------------|--|
| 1 | 发送日期 | 8 位数字 格式:yyyymmdd | Yyyy 表示年,mm 表示月,dd 表示日 |
| 2 | 发送时间 | 8位字符 格式:hh:mm:ss | Hh 表示小时, mm 表示分, ss 表示秒 |
| 3 | 信息类型 | 12 位字符 仅 3 种类型 | 信息公告,上市公司信息,紧急公告 |
| 4 | 消息来源 | 字符串 | 如果是来自深交所的公告,消息来源为"深圳 证券交易所" |
| 5 | 主标题 | 字符串 | 公告标题 |
| 6 | 副标题 | 字符串 | (1)副标题一般为空,当副标题出现"走马灯"字样时,在首页走马灯位置显示公告正文内容。 (2)当多个文件出现"走马灯"要求时,由新到旧开始显示。 (3)走马灯文件只在当天有效。 |
| 7 | 主题词 | 字符串 | 有多个主题词时,主题词之间用","分隔 |

信息公告文件的主题词

主题词是公告信息的关键内容的索引。对于一些固定内容的特殊公告,我们使用固定的主题词进行特别的标注。这些特别的公告和主题词的对应关系,如下表所示。

信息公告文件的主题词定义 (表 2-3)

| 序号 | 信息类型 | 信息内容 | 主题词 | | |
|----|------------|-------------------|--|--|--|
| | | 深圳证券市场 A 股交易公开信息 | 公开信息, 主板 A 股 | | |
| | | 深圳证券市场B股交易公开信息 | 公开信息, 主板 A 股 | | |
| | | 深圳证券市场封闭式基金交易公开信息 | 公开信息, 封闭式基金 | | |
| | | 中小企业板交易公开信息 | 公开信息, 中小企业板 | | |
| | 信息公告 | 深圳证券市场权证交易公开信息 | 公开信息, 权证 | | |
| | | 深圳证券市场权证超比例持有人信息 | 权证, 超比例持有 | | |
| | | 深圳证券市场融资融券标的证券信息 | 融资融券, 标的证券 | | |
| | | 深圳证券市场融资融券可充抵保证金证 | 融资融券, 可充抵保证金证券 | | |
| | | 券信息 | 陈 贝 陈 分 , | | |
| 2 | 上市公司 信息 | 深市上市公司信息摘要 | 上市公司信息 | | |
| 3 | 紧急公告 | XXXX 股票临时停牌的公告 | 临时停牌, nnnnnn (nnnnnn 为停牌证券代码,当 同一公司有多个证券时,证券 代码之间用","分隔。) | | |



信息公告文件示例

信息公告文件样例如下(注:省略了公告的具体内容)。

(1) 示例 1: XX060727.801

发送日期: 20060727

发送时间: 08:38:16

信息类型:信息公告

消息来源: 深圳证券交易所

主标题: 深圳证券市场 A 股交易公开信息

副标题:

主题词: 公开信息, 主板 A 股

深圳证券市场主板 A 股交易公开信息 (2006年07月26日)

(2) 示例 2: GS060727.701

发送日期: 20060727

发送时间: 08:42:04

信息类型: 上市公司信息

消息来源: 巨潮资讯网

主标题: 深市上市公司信息摘要

副标题:

主题词: 上市公司信息

深圳上市公司信息公告摘要 2006年07月27日

(来源:巨潮资讯网)

(3) 示例 3: GG060509.901

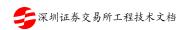
发送日期: 20060509

发送时间: 15:50:15

信息类型: 紧急公告

消息来源: 深圳证券交易所

主标题: 深圳证券交易所关于苏宁电器股票临时停牌的公告(模拟演练)



副标题: 走马灯

主题词: 临时停牌, 002024

(4) 示例 4: GG060509.902

发送日期: 20060509

发送时间: 15:50:15

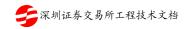
信息类型: 紧急公告

消息来源:深圳证券交易所

主标题: 深圳证券交易所关于万科股票临时停牌的公告

副标题:

主题词: 临时停牌, 000002, 200002, 125002



股份结算接口规范 三、

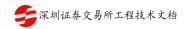
本部分接口规范包括股份结算信息库(SJSGF.dbf)、股份结算对帐库 (SJSDZ.dbf)、证券交易统计库(SJSTJ.dbf)、 席位信息库(SJSXW.dbf)和 LOF 结算信息库(LOFJS.dbf)五个接口库,前四个是A、B股共用接口库,最后一 个是通过深交所办理 LOF 业务的专用接口库, 其中股份结算信息库、股份结算对 帐库、证券交易统计库和 LOF 结算信息库在每个交易日收市后给相应席位传送一 次,同时存放一份于相应席位在深交所通信主机上的信箱内;席位信息库存放在 深交所通信主机上的信箱内,券商可以根据需要收取。此外还包括 B 股结算指令 库(SJSZL.dbf)和B股结算指令状态库(SJSZT.dbf)两个B股境外券商专用接 口库,通过 B-COM 系统发送和接收。券商系统应该根据开展的业务种类而对相 应的接口库进行处理。

本部分接口规范中的席位代码是指结算席位代码。

8. 股份结算信息库 SJSGF.dbf

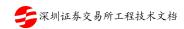
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|-----------|----|------|----------|
| 1 | GFXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | GFZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 3 | GFGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 4 | GFYWLB | 业务类别 | C | 2 | |
| 5 | GFSFZH | 身份证号/注册号码 | С | 30 | |
| 6 | GFWTXH | 委托序号 | C | 8 | |
| 7 | GFWTGS | 委托股数 | N | 12,0 | |
| 8 | GFQRGS | 确认股数 | N | 12,0 | |
| 9 | GFZJJE | 资金金额 | N | 15,3 | |
| 10 | GFCWDH | 错误代号 | С | 3 | |
| 11 | GFFSRQ | 发送日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 12 | GFBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) **GFXWDM**(字段 1: 席位代码)、**GFZQDM**(字段 2: 证券代码)、 GFGDDM(字段 3: 证券账户)和 GFYWLB(字段 4: 业务类别)四个字段为本接口 库的关键字。
- (2) GFSFZH(字段5:身份证号/注册号码), 左对齐存放自然人身份证号, 或法人的注册号码,不足 30 位右端填入空格。本字段视业务需要填入数据,业 务不涉及本字段时则本字段全部为空格。
 - (3) **GFWTXH**(字段 6: 委托序号)和 **GFWTGS**(字段 7: 委托股数)两字段



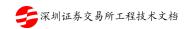
用于非交易的委托类结算业务,如报盘转托管,报盘配股认购,可转债报盘业务,股票质押报盘业务等。本接口库返回的记录中将原"委托序号"及"委托股数"填写于此两字段。未使用该两字段的其值为空格和零。

- (4) **GFCWDH**(字段 10: 错误代号),对于相关委托类结算业务,经结算系统检查后会给出"确认"或"不确认"的信息。若 **GFCWDH**=空格,则表示委托类结算业务的该笔申报被"确认";否则,字段 **GFCWDH** 的值就是"不确认"的原因代码,其对应的错误含义见文档最后的表六。
- (5) GFYWLB(字段 4: 业务类别),本字段的定义(见表七)将决定 GFQRGS (字段 8: 确认股数)与 GFZJJE(字段 9: 资金金额)的对应处理方法。表七中的'Y'表示对该笔记录的 GFQRGS或 GFZJJE 做相应记帐处理,'N'则表示不需做记帐处理,仅用于对帐。

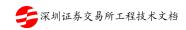


业务类别含义表 (表七)

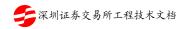
| GFYWLB | | 相应业务含义 | GFQRO | GS | | GFZJJE | | |
|--------|----------|----------------------------|-----------|----|---|--------|----|---|
| 01 | 新股登记。包括股 | 票、债券的登记。 | 新股登记股数/张数 | >0 | Y | | =0 | |
| 03 | 股份托管。含实物 | 股票、内部职工股和其他非流通股份的托管。 | 托管股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 11 | 合并证券账户 | GFQRGS<0,为被合并方股东记录 | 被合并方股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为合并方股东记录 | 合并方股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 14 | 更换证券账户 | GFQRGS<0,为被更换的证券账户记录 | 被更换方股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为更换后新证券账户记录 | 更换方股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 20 | 红股到帐及股息 | 红股到帐 | 红股股数 | >0 | Y | | =0 | N |
| | 派发 | 股息派发 | | =0 | N | 股息 | >0 | Y |
| 21 | 配股权证到帐 | | 配股权证张数 | >0 | Y | | =0 | |
| 22 | 配股认购 | GFQRGS<0 为确认记录。GFQRGS 为应扣减 | 确认张数 | <0 | Y | 认购款 | <0 | Y |
| | | 的权证张数,不得作为股份记加的依据。 | | | | | | |
| | | GFZJJE 为应扣减的认购款。 | | | | | | |
| | | GFQRGS=0 为不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| 23 | 配股到帐。即配股 | 权证认购结束后,一次性转为相应的股票数 | 认购股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 25 | 转托管业务中转 | GFQRGS<0 表示转托管成功 | 转出股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | 出席位记录 | GFQRGS=0 表示转托管不成功 | | =0 | | | =0 | |
| 26 | 转托管业务中转入 | 席位记录 | 转入股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 30 | 可转债转股(含报 | GFQRGS<0,为确认债券记录 | 转债张数 | <0 | Y | | =0 | |
| | 盘自愿转股和强 | GFQRGS=0,为报盘不确认债券记录 | | =0 | | | =0 | |
| | 制性转股) | GFQRGS>0,为股票记录。转换后的零债折 | 股票股数 | >0 | Y | 零债现金 | ≥0 | Y |
| | | 算成现金在 GFZJJE 中返还 | | | | | | |
| 33 | 可转债回售 | GFQRGS<0,为报盘确认记录 | 回售张数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS=0,为报盘不确认记录 | | =0 | | | =0 | |



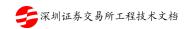
| GFYWLB | | 相应业务含义 | GFQR | GS | | GFZJJE | | |
|---------------|---------------|-------------------------|--------|----|---|--------|----|---|
| 34 | 可转债回售截止后 | 资金(在 GFZJJE 中)返还记录 | | =0 | | 回售款 | >0 | Y |
| 35 | 可转债赎回。 | | 赎回张数 | <0 | Y | 赎回款 | >0 | Y |
| 40 | 股份转让 | GFQRGS<0, 为转让方股东记录 | 转让股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0, 为承让方股东记录 | 承让股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 41 | 股份特殊调帐 | GFQRGS<0, 为调出方股东记录 | 调出股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0, 为调入方股东记录 | 调入股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 50 | 债券存提券 | GFQRGS<0, 为提券记录 | 提券张数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0, 为存券记录 | 存券张数 | >0 | Y | | =0 | |
| 51 | 国债分销业务。G | FZQDM 为分销临时代号 | 分销张数 | >0 | Y | | =0 | |
| 60 | 资金解冻(包括股 | .息、权证自动行权所得资金等)。 | | =0 | | 解冻资金 | >0 | Y |
| 65 | 法人转配股转股 | GFQRGS<0, 为被转的配股记录 | 转配股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0, 为对应的股票记录 | 股票股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 66 | 证券转换 | GFQRGS<0, 为被转证券记录 | 转出股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0, 为转至证券记录 | 转入股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 68 | 流通股份政策性转 | 非流通 | 冻结股数 | <0 | Y | | =0 | |
| 69 | 非流通股份政策性 | 转流通 | 解冻股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 7A | 流通股冻结。 | | 实际冻结股数 | >0 | N | 原轮候序号 | >0 | |
| | GFSFZH,第 1~10 | 位表示冻结序号,第11~18位表示冻结起始日, | | | | | | |
| | 第 21~28 位表示冻 | 结截止日, 第30位表示联冻深度。日期格式为 | | | | | | |
| | YYYYMMDD。 如 | 2果冻结截止日为空,则表示无限期冻结。 | | | | | | |
| | GFWTXH,如果空 | 它则表示该笔冻结是在结算公司办理的或是已冻 | | | | | | |
| | 结股份产生的权益 | .,或是轮候冻结生效。 | | | | | | |
| | 轮候冻结生效的冻 | 结,GFZJJE 的整数部分表示原轮候序号。 | | | | | | |
| 7B | 流通股解冻。 | | 实际解冻股数 | >0 | N | | | |
| | GFSFZH,第 1~10 |) 位表示原始冻结序号。 | | | | | | |



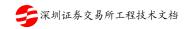
| GFYWLB | | 相应业务含义 | GFQR | GS | | GI | FZJJE | |
|---------------|---|----------------------------|----------|----|---|----|-------|---|
| | GFWTXH, 如果空 | 区则表示该笔解冻是在结算公司办理的。 | | | | | | |
| 7C | 流通股续冻。 | | | =0 | N | | | |
| | GFSFZH,第 1~10 | 位表示原始冻结序号,第 21~28 位表示续冻截 | | | | | | |
| | 止日, 日期格式为 | YYYYMMDD。如果续冻截止日为空,则表示 | | | | | | |
| | 无限期续冻。 | | | | | | | |
| | GFWTXH,如果空 | 区则表示该笔续冻是在结算公司办理的。 | | | | | | |
| 7D | 流通股冻结轮候。 | | 实际冻结轮候股数 | >0 | N | | | |
| | GFSFZH,第 1~10 |) 位表示轮候序号,第 19~20 位表示确认的轮候 | | | | | | |
| | , | 最大轮候冻结期限为99个月。 | | | | | | |
| | GFWTXH,如果空 | E则表示该笔轮候冻结是在结算公司办理的。 | | | | | | |
| 7E | 流通股冻结轮候解 | | | =0 | N | | | |
| | GFSFZH,第 1~10 | | | | | | | |
| | | E则表示该笔轮候解除是在结算公司办理的。 | | | | | | |
| 70 | 无股份冻结质押 | GFQRGS<0,为出质人确认记录 | 质押股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | 转入债券质押库时,GFQRGS 为转入质押库 | | | | | | |
| | | 的债券张数 | | | | | | |
| | | GFQRGS=0,为出质人/质权人不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为质权人确认记录 | 质押股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 71 | 股份质押且冻结 | GFQRGS<0,为出质人确认记录 | 质押股数 | <0 | Y | | | |
| | | GFQRGS=0,为出质人/质权人不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为质权人确认记录 | 质押股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 72 | 无股份冻结解押 | GFQRGS<0,为质权人确认记录 | 解押股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS=0,为出质人/质权人不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为出质人确认记录 | 解押股数 | ≥0 | Y | | ≥0 | Y |
| | | 转出债券质押库时,GFQRGS 为转出质押库 | | | | | | |



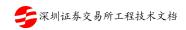
| GFYWLB | | 相应业务含义 | GFQR | GS | | GF | ZJJE | |
|--------|-----------------------------------|---|----------|----|---|---------------|------|---|
| GIIWED | | 的债券张数;如果债券在质押期间已派息或兑付本息,则通过 GFZJJE 返回转出债券已派息金额或已兑付的本息金额 | or year | | | | 2502 | |
| 73 | 股份解押且解冻 | GFQRGS<0,为质权人确认记录 GFQRGS=0,为出质人/质权人不确认记录 | 解押股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为出质人确认记录 | 解押股数 | >0 | Y | | =0 | |
| 76 | 预受要约确认。 | GFQRGS<0,为预受要约确认记录 | 预受要约股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | GFSFZH左6位为 收购人编码,右补 空格。 | GFQRGS=0,为预受要约不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| 77 | 解除预受要约确 | GFQRGS>0,为解除预受要约确认记录 | 解除预受要约股数 | >0 | Y | | =0 | |
| | 认 GFSFZH 左 6 位为收购人编码, 右补空格。 | GFQRGS=0,为解除预受要约不确认记录 | | =0 | | | =0 | |
| 78 | 资金确认记录 GFSFZH左6位为 | 股权收购业务出让方和受让方过户后资金确 认记录 | | =0 | N | 出让方应收 转让金额 | >0 | Y |
| | 收购人编码, 右补 空格。 | | | | | 受让方应付 转让金额 | <0 | Y |
| Z2 | T 日 B 股成交资 | GFQRGS>0, 为买入记录 | 买入股数 | >0 | N | 成交价格 | >0 | N |
| | 料(发给券商及指 定托管银行) | GFQRGS<0, 为卖出记录 | 卖出股数 | <0 | N | | | |
| Z3 | T-2 日 B 股成交资 | GFQRGS>0, 为买入记录 | 买入股数 | >0 | Y | 成交价格 | >0 | N |
| | 料(发给券商) | GFQRGS<0, 为卖出记录 | 卖出股数 | <0 | Y | | | |
| Z4 | B股二类交收指令 | 配对结果(T+1 日交收) | 转入股数 | >0 | Y | 转入金额 | >0 | Y |
| | | | 转出股数 | <0 | Y | 转出金额 | <0 | Y |



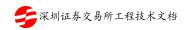
| GFYWLB | 相 | GFQRG | S | | GF | ZJJE | | |
|--------|---------------------|-------------------------|-----------|----------|----|------|----|---|
| A0 | 新股申购记录, 用于券商冻 | 结股民申购资金。 | 申购股数 | >0 | N | 申购价格 | >0 | N |
| A1 | 新股申购不确认记录,用 |]于券商释放股民申购资金。其中 | 不确认股数 | >0 | N | 申购价格 | ≥0 | N |
| | GFCWDH 为不确认原因。 | | | | | | | |
| A2 | 新股申购配号记录。GFWT | GS 存放起始配号,GFQRGS 存放包 | 配号个数 | >0 | N | | =0 | N |
| | 括起始号在内的连续配号个 | 数。(GFWTGS+GFQRGS -1 即为截 | | | | | | |
| | 止号) | | | | | | | |
| A6 | 新股有效申购记录。用于券 | 商释放股民申购资金。 | 申购股数 | >0 | N | 申购价格 | >0 | N |
| A3 | 新股发行结果记录。GFWT | GS 为中签号码。 | 确认股数 | >0 | N | 确认价格 | ≥0 | N |
| A4 | 二级市场投资者可配售股数 | 0 | 可配售股数 | >0 | N | | =0 | N |
| A5 | 向二级市场投资者按市值配 | 售新股认购确认记录。GFWTGS 为认 | 确认股数 | ≥ 0 | N | 认购价格 | >0 | N |
| | 购委托股数。 | | | | | | | |
| B1 | 交收锁定。包括LOF、权证 | 等各类证券交收锁定的总股数。 | 锁定总股数 | >0 | Y | | =0 | |
| B2 | 流通股冻结与交收锁定的总 | 股数,包括交收锁定总股数(GFYWLB | 总股数 | >0 | N | | =0 | |
| | =B1)+冻结总股数。GFWTC | GS 为 0。 | | | | | | |
| В3 | 卖空记录。GFWTGS 为该 | 席位当日卖空股数(包括"中途先行卖 | 累计未补购卖空股数 | <0 | N | | =0 | N |
| | 空"股数),营业部要据此交 | 纳罚金。GFQRGS 为累计卖空未补购 | | | | | | |
| | 股数。 | | | | | | | |
| | 如果 GFZQDM 为 131990, | 则 GFQRGS 表示质押库欠库的国债 | | | | | | |
| | 回购标准券的张数。 | | | | | | | |
| | - | 则 GFQRGS 表示质押库欠库的企业 | | | | | | |
| | 债回购标准券的张数。 | | | | | | | |
| B4 | 债券未到期回购合约。 | GFQRGS>0,债券回购买方记录 | 未到期回购张数 | >0 | N | 回购价格 | >0 | N |
| | | GFQRGS<0,债券回购卖方记录 | | <0 | | | | |
| | 左22位为合同序号。 | | | | | | | |
| B5 | 无效证券账户挂帐 | | 挂帐股数 | >0 | N | | =0 | N |



| GFYWLB | 相应业绩 | 相应业务含义 | | | | Gl | FZJJE | |
|---------------|---|---|-------------|-------|------|--------------------|----------------|---|
| В6 | 保管股份余额记录 | | 投资者保管股份总额 | >0 | N | | =0 | N |
| В7 | | QFII 对帐数据。由于 QFII 的股份托管在银行席位下,本记录向需要对帐的券商提供 QFII 的股份余额数据。 | | | N | | =0 | N |
| В8 | 资金交收违约的待处分证券回报。 GFWTGS=0, GFQRGS 为待处分记 GFSFZH 第 1~8 位表示成交日期 位,表示成交当日的成交号码。 | 待处分证券股数 | <0 | Y | 成交价格 | >0 | N | |
| X1 | 国债利息 | | 100,000,000 | >0 | N | 应计利息 *100000000 | >0 | N |
| 0В | QFII 证券交易买入成交记录 若 GFWTXH 为'DZ',表示该笔交易为大宗交易。 | | 成交数量 | | | 成交价格 | | |
| 0S | QFII 证券交易卖出成交记录 若 GFWTXH 为'DZ',表示该笔 | 交易为大宗交易。 | 成交数量 | | | 成交价格 | | |
| W0 | T 日对权证行权申请的回报。如 行权申请失败,则回报记录有错 | 权证回报 | 应付股数 | ≤0 | N | 应交收资金 (已扣税费) | >0 应收 <0 应付 | N |
| | 误代码,GFCWDH 不空。 | 标的证券回报(仅适用于以证 券给付方式结算的权证行权委 托) | 应收应付股数 | >0,应收 | N | | | |
| W1 | T+1 日以现金结算的认沽权证交 收回报。未完成交收的, GFQRGS 为 0, GFCWDH 不空。 | GFQRGS<0,权证记减 | 实际交收股数 | ≤0 | Y | 应收资金 (已扣税费) | ≥0 | Y |
| W2 | T+1 日以证券给付结算的认沽权 | GFQRGS<0,标的证券记减 | 过户股数 | <0 | Y | | | |
| | 证交收回报。未完成交收的, GFQRGS为0,GFCWDH不空。 | GFQRGS<0,权证记减 | 实际交收股数 | ≤0 | Y | 应收资金 (已扣税费) | ≥0 | Y |



| CEVIVI D | | 上中台北方 | 2 & 3 | CEO | DCC | | GFZJJE | | | |
|----------|------------------|------------|--------------------------|--------|-----|---|---------|-------|---|--|
| GFYWLB | | 相应业务 | | GFQ | KGS | | | EZJJE | | |
| W3 | T+1 日以现金结算的认 | | GFQRGS<0,权证记减 | 实际交收股数 | ≤0 | Y | 应付资金 | ≥0 | Y | |
| | 收回报。未完成交收的, | GFQRGS | | | | | (已扣税费) | | | |
| | 为 0, GFCWDH 不空。 | | | | | | | | | |
| W4 | T+1 日以证券给付结算 | 的认购权 | GFQRGS>0,标的证券记加 | 过户股数 | >0 | Y | | | | |
| | 证交收回报。未完成 | 交收的, | GFQRGS<0,权证记减 | 实际交收股数 | ≤0 | Y | 应付资金 | ≤0 | Y | |
| | GFQRGS 为 0,GFCWI | DH 空。 | | | | | (已扣税费) | | | |
| W5 | 权证卖空代为补入记录 | 。 GFWTXI | | 代为补入股数 | >0 | Y | | | | |
| L7 | T-1 日 ETF 申购/赎回的 | 现金差额。 | | | =0 | | 现金差额 | >0 应收 | Y | |
| | GFZQDM 为 ETF 证券化 | 代码。 | | | | | | <0 应付 | | |
| | GFZJJE>0,则投资者应 | 2收资金, 2 | 否则投资者应付资金。 | | | | | | | |
| L8 | ETF 现金替代的多退少补。 | | | | =0 | | >0 表示退款 | >0 应收 | Y | |
| | GFZJJE>0,则退给投资 | *者资金, ~ | 5则投资者应补交资金。 | | | | <0表示补款 | <0 应付 | | |
| | GFZQDM 为 ETF 证券化 | 代码。 | | | | | | | | |
| | GFSFZH 第 1~8 位表示 | 下委托日期, | 格式是 CCYYMMDD, 第 9~17 | | | | | | | |
| | 位表示委托当日的成交 | 号码,第2 | 25~30 位表示现金替代的组合证 | | | | | | | |
| | 券的证券代码。 | | | | | | | | | |
| R1 | 担保证券 GFQRGS<0 | 0, 为划出方 | 记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10 | 划出股数 | <0 | Y | | =0 | | |
| | 提交与返 位)为划入之 | 方股东代码 | ,最后后 6 位(25~30 位)为划入 | | | | | | | |
| | 还 方席位代码 | 4 . | | | | | | | | |
| | GFQRGS>(|), 为划入方 | 记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10 | 划入股数 | >0 | Y | | =0 | | |
| | 位)为划出之 | 方股东代码 | ,最后后 6 位(25~30 位)为划出 | | | | | | | |
| | 方席位代码 | . | | | | | | | | |
| R2 | 融券券源 GFQRGS<0 | D, 为划出方 | ·记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10 | 划出股数 | <0 | Y | | =0 | | |
| | 划拨 位)为划入之 | 方股东代码 | ,最后后 6 位(25~30 位)为划入 | | | | | | | |
| | 方席位代码 | . | | | | | | | | |



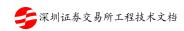
| GFYWLB | | 相应业务含义 | GFQRGS | | | GFZJJE | | |
|--------|------------|---|--------|----|---|--------|----|--|
| | | GFQRGS>0,为划入方记录,GFSFZH的前10位(1~10位)为划出方股东代码,最后后6位(25~30位)为划出方席位代码。 | | >0 | Y | | =0 | |
| R3 | 现券还券 划拨 | GFQRGS<0, 为划出方记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10位)为划入方股东代码。 | 划出股数 | <0 | Y | | =0 | |
| | | GFQRGS>0,为划入方记录,GFSFZH的前10位(1~10位)为划出方股东代码。 | 划入股数 | >0 | Y | | =0 | |

注:

(1) 新股发行返回数据说明:

市值配售方式: (T日为申购日)

| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|-------|--------------|--|
| T-2 日 | A4,投资者可申购记录 | 若同一投资者在不同席位托管有股份,则每个席位均会收到该投资者的可申购量,且相同。 |
| T日 | A1, 申购不确认记录 | 因证券账户无效等原因引起的不确认记录,GFQRGS=不确认股数,GFZJJE=0,GFCWDH=不确认原因代号 |
| (申购日) | A2, 配号记录 | GFWTGS=起始配号,GFQRGS=连续配号个数,GFZJJE=0。 |
| | | 投资者若超额申购,则只返回确认的配号数量。 |
| T+1 日 | A3, 中签记录 | 一个中签号码一条记录,若同一投资者有多个中签号码,则有多条记录。 |
| (中签日) | | 其中,GFWTGS=中签号码,GFQRGS=中签股数,GFZJJE=0。 |
| T+3 日 | A5, 市值配售确认记录 | GFWTGS=中签股数, GFQRGS=最终确认股数 (若申报了放弃认购股数,则 GFQRGS= GFWTGS- 放弃认购 |
| (放弃日) | | 股数,否则 GFQRGS= GFWTGS);GFZJJE=认购价格;GFQRGS*GFZJJE=最终应わ资金;GFWTXH=空格; |

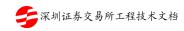


上网定价方式:

| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|-----|-------------|---|
| 申购日 | A0,全部申购记录 | 结算公司收到的但未经确认处理的全部申购记录,券商可据此冻结投资者申购资金。其中,GFQRGS=申 |
| | | 购股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE=冻结资金。 |
| | A1, 申购不确认记录 | 因证券账户无效等原因引起的不确认记录,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不 |
| | | 确认股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号,GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |
| 配号日 | A1, 申购不确认记录 | 因申购资金不到位引发的不确认记录,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不确认 |
| | | 股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号,GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |
| | A2, 配号记录 | GFWTGS=起始配号,GFQRGS=连续配号个数,GFZJJE=0。 |
| 中签日 | A3, 中签记录 | 一个中签号码一条记录,若同一投资者有多个中签号码则有多条记录。其中,GFWTGS=中签号码, |
| | | GFQRGS=中签股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE=最终应扣资金。 |
| | A6,全部有效申购记录 | 券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=申购股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE= |
| | | 解冻资金。 |

增发定价/竞价方式: (T日为申购日)

| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|-------|----------------|---|
| T-1 日 | A4, 老股东优先可配售记录 | 若同一投资者在不同席位托管有股份,则每个席位均会收到该投资者的可申购量,且相同。 |
| ΤE | A0,全部申购记录 | 结算公司收到的但未经确认处理的全部申购记录,券商可据此冻结投资者申购资金。其中,GFQRGS=申 |
| (申购日) | | 购股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE=冻结资金。 |
| | A1, 申购不确认记录 | 因证券账户无效等原因引起的不确认记录,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不 |
| | | 确认股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号,GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |
| T+2 日 | A1 | 因申购资金不到位引发的不确认记录,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不确认 |
| | | 股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号,GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |



| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|---------|-------------|---|
| T+3 日 | A3, 认购结果记录 | 比例配售结果。老股东如果超额申购,也只有一条记录,已经将优先配售获配部分与超额获配部分合并。 |
| (比例配售日) | | 其中,GFWTGS=0,GFQRGS=获配股数,GFZJJE=配售价格,GFQRGS*GFZJJE=最终应扣资金。 |
| | A6,全部有效申购记录 | 券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=申购股数,GFZJJE=申购价格, |
| | | GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |

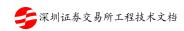
LOF/ETF 连续认购方式: (T日为申购日)

| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|-------|-------------|---|
| T日 | A0,全部申购记录 | 结算公司收到的但未经确认处理的全部申购记录,券商可据此冻结投资者申购资金。其中,GFQRGS=申 |
| (申购日) | | 购股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE=冻结资金。 |
| | A1, 申购不确认记录 | 因证券账户无效等原因引起的不确认记录,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不 |
| | | 确认股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号,GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。 |
| T+2 日 | A1, 申购不确认记录 | 因申购资金不到位,或比例认购(针对T日为最后申购日的情况)引发的不确认记录,券商可据此解冻相 |
| (认购日) | | 应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=不确认股数,GFZJJE=申购价格,GFCWDH=不确认原因代号, |
| | | GFQRGS*GFZJJE=解冻资金。如果一笔申购委托同时出现申购资金不到位和比例认购的情况,也只发送一 |
| | | 笔 A1 记录。 |
| | A3, 认购结果记录 | 同一投资者有重复申购,则有多条认购结果记录。其中,GFWTGS=0,GFQRGS=认购股数,GFZJJE=认 |
| | | 购价格,GFQRGS*GFZJJE=最终应扣资金。 |
| | A6,全部有效申购记录 | 券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,GFQRGS=申购股数,GFZJJE=申购价格,GFQRGS*GFZJJE= |
| | | 解冻资金。 |

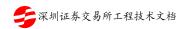
(2) B 股结算数据说明

B股结算数据的说明中,T日指数据发送日期(字段11: GFFSRQ)。

GFYWLB=20: 红股到帐及股息派发。对B股而言,该业务类别的数据是股权登记日为T-3日的所有证券的分红派息数据。



- GFYWLB=Z2: T日B股成交资料(发给券商及指定托管银行)。GFWTXH=合同序号最后8位(委托流水号),GFWTGS=0。在发送给券商的成交资料中,GFXWDM=券商席位代码,GFSFZH为空;在发送给托管银行的成交资料中,GFXWDM=托管银行代码,GFSFZH左边6位为券商席位代码,右补空格。
- GFYWLB=Z3: T-2 日 B 股成交资料(发给券商)。GFWTXH=合同序号最后 8 位(委托流水号),GFWTGS=0,GFXWDM=券商席位代码,GFSFZH为空。由券商自行计算成交金额、印花税、交易手续费、清算费等税费的明细额,与资金试交收和资金正式交收数据核对。
- GFYWLB=Z4: B 股二类交收指令配对结果(T+1日交收)。GFWTGS=券商通过二类指令报送的委托股数。GFCWDH 若为空,则表示指令配对成功, GFQRGS=应收付的股数,GFZJJE=应收付的资金金额; 否则,表示配对失败,GFQRGS=0,GFZJJE=0,GFSFZH 用于表示不配对原因,定义为:
 - 1-2 位等于"70"表示没有与该指令配对的指令;
 - 1-2 位等于"71"表示股数不相配;
 - 3-4 位等于"72"表示付款类别不相配;
 - 5-6 位等于"73"表示付款金额不相配;
 - 7-8位等于"74"表示对手方不相配;
 - 9-10 位等于"51"表示证券代码无效;
 - 11-12 位等于"52"表示席位代码无效;
 - 13-14 位等于"53"表示证券账户无效;
 - 15-16 位等于"54"表示指令类别无效;
 - 17-18 位等于"55"表示付款类别无效;



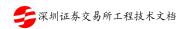
- 19-20 位等于"56"表示对手方席位代码无效;
- 21-22 位等于"57"表示席位代码等于对手方席位代码;
- 23-24 位等于"58", 表示委托序号无效;
- 25-26 位等于"59"、表示业务代号无效;
- 27-30 位填入空格。

(3) QFII 成交结算数据

GFYWLB='0S'或'0B': GFXWDH=托管人结算编号,GFGDDM=合格境外投资者证券帐户,GFSFZH 左 22 位存放成交合同序号, 其中合同序号左 6 位为表示合格境外投资者报盘委托席位的数字串, 其后 8 位为成交日期(CCYYMMDD), 最后 8 位为委托流水号; GFWTXH 为空,GFWTGS=0; GFQRGS=成交数量,对于 A 股其单位为股,对于国债、企业债、可转换债券其单位为手,对于基金其单位为份。GFZJJE=成交价格,GFCWDH 为空,GFFSRO=成交日期。

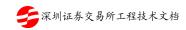
(4) QFII 的 ETF 申购赎回数据

| 回报类型 | GFYWLB | 说明 |
|----------------|--------|--|
| ETF申购的回报 | 0B | GFZQDM=ETF 基金代码,GFQRGS=申购份额,GFZJJE=0 |
| ETF 申购中组合证券的回报 | 0S | GFZQDM=组合证券的证券代码,GFQRGS=申购所使用的组合证券的股数,GFZJJE=0 |
| ETF 申购中现金替代的回报 | 0B | GFZQDM=组合证券的证券代码,GFQRGS=0,GFZJJE=现金替代金额,且大于零 |
| ETF 赎回的回报 | 0S | GFZQDM=ETF 基金代码,GFQRGS=赎回份额,GFZJJE=0 |
| ETF 赎回中组合证券的回报 | 0B | GFZQDM=组合证券的证券代码,GFQRGS=赎回所获得的组合证券的股数,GFZJJE=0 |
| ETF 赎回中现金替代的回报 | 0S | GFZQDM=组合证券的证券代码,GFQRGS=0,GFZJJE=现金替代金额,且大于零 |



(4) 权证行权业务结算数据说明

| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|-------|--------------|---|
| TE | W0, 行权申请回报 | 结算公司收到全部行权申请记录。 |
| (委托日) | | GFZQDM 为权证代号时: |
| | | 如果 GFQRGS=0 的记录表示申请失败,GFCWDH 中有相应的错误原因。 |
| | | 如果 GFQRGS =GFWTGS,则表示委托被接受,券商应根据 GFZJJE 中的资金金额、GFQRGS 中的确认股数 |
| | | 准备券、资以备次日进行行权交收。其中 GJZJJE 已扣投资者的税费,不含券商的结算费。 |
| | | GFZQDM 为标的证券时: |
| | | GFWTGS=0,GFQRGS=待交收标的证券数量。 |
| | | 如果是投资者申请行权,则 GFSFZH 第 1~8 位表示行权申请日期(T 日),格式是 CCYYMMDD,第 9~17 位, |
| | | 表示行权申请当日(T 日)的成交号码。 |
| | | 如果是到期自动行权,则 GFSFZH 为空。 |
| T+1 日 | W1, 以现金方式结算的 | GFZQDM 为权证代号。 |
| (交收日) | 认沽权证交收回报 | GFQRGS=0表示交收失败,GFCWDH中有相应的错误原因,否则表示行权成功。 |
| | | GFQRGS<0,表示行权成功,该数量的权证将被注销,且 GFZJJE>0,表示投资者实际应收资金,已扣除投 |
| | | 资者的相关税费。 |
| | | 如果是投资者申请行权,则 GFSFZH 第 1~8 位表示行权申请日期(T 日),格式是 CCYYMMDD,第 9~17 位, |
| | | 表示行权申请当日(T 日)的成交号码。 |
| | | 如果是到期自动行权,则 GFSFZH 为空。 |
| | W3, 以现金方式结算的 | GFZQDM 为权证代号。 |
| | 认购权证交收回报。 | GFQRGS=0表示交收失败,GFCWDH中有相应的错误原因,否则表示行权成功。 |
| | | GFQRGS<0,表示行权成功,该数量的权证将被注销,且 GFZJJE<0,表示投资者实际应付资金,已含投资 |
| | | 者的相关税费。 |
| | | 如果是投资者申请行权,则 GFSFZH 第 1~8 位表示行权申请日期(T 日),格式是 CCYYMMDD,第 9~17 位, |
| | | 表示行权申请当日(T 日)的成交号码。 |
| | | 如果是到期自动行权,则 GFSFZH 为空。 |

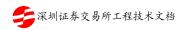


| 日期 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|----|-------------|--|
| | W2,以证券给付方式结 | GFQRGS=0 表示交收失败,GFCWDH 中有相应的错误原因,否则表示行权成功。 |
| | 算的认沽权证交收回报 | GFZQDM 为权证代号时: |
| | | GFQRGS<0,表示注销该数量的权证,应记减;且 GFZJJE>0,表示投资者实际应收资金,已扣除投资者的 |
| | | 相关税费。 |
| | | GFZQDM 为标的证券时,GFWTGS=0: |
| | | GFQRGS<0,表示扣除该数量的标的证券,应记减。 |
| | | 如果是投资者申请行权,则 GFSFZH 第 1~8 位表示行权申请日期(T 日),格式是 CCYYMMDD,第 9~17 位, |
| | | 表示行权申请当日(T日)的成交号码。 |
| | W4,以证券给付方式结 | GFQRGS=0 表示交收失败,否则表示行权成功。 |
| | 算的认购权证交收回报 | GFZQDM 为权证代号时: |
| | | GFQRGS<0,表示注销该数量的权证,应记减;且 GFZJJE<0,表示投资者实际应付资金,已含投资者的相 |
| | | 关税费。 |
| | | GFZQDM 为标的证券时,GFWTGS=0: |
| | | GFQRGS>0,表示登记该数量的标的证券,应记加。 |
| | | 如果是投资者申请行权,则 GFSFZH 第 1~8 位表示行权申请日期(T 日),格式是 CCYYMMDD, 第 9~17 位, |
| | | 表示行权申请当日(T 日)的成交号码。 |
| | | 如果是结算公司根据业务规则进行代为行权,则 GFSFZH 第 27~30 位表示代为行权,为拼音缩写"DWXQ", |
| | | GFWTXH 为空,GFWTXH 为空,GFWTGS 为 0。 |

(5) 权证业务卖空处置的结算数据说明

| 违约情况 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|------------|-------------|----------------------|
| 权证卖空, 结算公司 | B3, 卖空 | 权证卖空,GFZQDM 为权证代码。 |
| 代为补入 | W5, 代为补入结果 | 权证数量增加。 |
| 标的证券卖空, 结算 | B3, 卖空 | 标的证券卖空,GFZQDM 为标的证券。 |

TS-0407-001



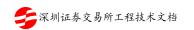
| 公司代为行权 | W5, 代为补入结果 | 权证数量增加。 |
|--------|------------|----------------|
| | W4, 代为行权结果 | 权证数量减少,标的证券增加。 |

(6) ETF 卖空处置的结算数据说明:

| 违约情况 | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|--------------|-------------|----------------------------|
| ETF 卖空, 结算公司 | B3, 卖空 | ETF 卖空,GFZQDM 为 ETF 的证券代码。 |
| 代为补入 | W5, 代为补入结果 | ETF 份额增加。 |

(7)要约收购结束当日的结算数据说明

| 要约收购结果 | | 业务类别 GFYWLB | 说明 |
|--------|------|----------------|--|
| 生效 | 股份方面 | 77 | 确认接受预受要约的股份解除保管: GFYWLB='77'; GFSFZH 中填有 6 位数字要约收购编码(左对齐, 右补空格); |
| | | | GFWTXH 为空;GFQRGS>0,是确认接受预受要约的汇总股数;其余字段填相应值 |
| | | 40 | 股份转让过户记录: GFYWLB='40'; GFSFZH 中填有 6 位数字要约收购编码 (左对齐,右补空格); GFWTXH 为 |
| | | | 空;GFQRGS<0,为股份出让方记录;GFQRGS>0,为股份受让方记录;其余字段填相应值。 |
| | 资金方面 | 78 | 收购资金记录:GFYWLB='78';GFZJJE>0,为股份出让方记录,GFZJJE=转让股数×转让价格-相关费用(包括 |
| | | | 面向出让方收取的交易经手费、监管规费、印花税); GFZJJE<0, 为股份受让方记录, GFZJJE=转让股数×转让价 |
| | | | 格+相关费用(包括面向受让方收取的交易经手费、监管规费、印花税); GFSFZH (身份证号)字段存放的是对 |
| | | | 应的收购编码,使用左边 6 位,右补空格;GFWTGS、GFQRGS = 0;GFWTXH 为空;其余字段填相应值。 |
| 未生效 | 股份方面 | 77 | 在确认解除保管当日收到接受预受要约的股份解除保管记录: GFYWLB='77'; GFSFZH 中填有 6 位数字要约收购 |
| | | | 编码(左对齐,右补空格); GFWTXH为空; GFQRGS>0,是确认接受预受要约的汇总股数; 其余字段填相应值。 |



9. 股份结算对帐库 SJSDZ.dbf

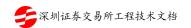
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|------|----------|
| 1 | DZXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | DZZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 3 | DZGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 4 | DZZYGS | 总拥股数 | N | 12,0 | |
| 5 | DZFSRQ | 发送日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 6 | DZBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) 该库为股东持股明细,供券商对帐用。DZZYGS(字段 4: 总拥股数) 为至发送日(DZFSRQ)当日交收完成后的股东总拥股数。
- (2) **DZXWDM**(字段 1: 席位代码)、**DZZQDM**(字段 2: 证券代码)、**DZGDDM**(字段 3: 证券账户)三个字段为本接口库的关键字。

10.证券交易统计库 SJSTJ.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|------|----------|
| 1 | TJXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | TJZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 3 | TJMRGS | 买入股数 | N | 12,0 | |
| 4 | TJMRZJ | 买入资金 | N | 15,3 | |
| 5 | TJMCGS | 卖出股数 | N | 12,0 | |
| 6 | TJMCZJ | 卖出资金 | N | 15,3 | |
| 7 | TJBJSF | 买经手费 | N | 15,3 | |
| 8 | TJSJSF | 卖经手费 | N | 15,3 | |
| 9 | TJBYHS | 买印花税 | N | 15,3 | |
| 10 | TJSYHS | 卖印花税 | N | 15,3 | |
| 11 | TJBGHF | 买过户费 | N | 15,3 | |
| 12 | TJSGHF | 卖过户费 | N | 15,3 | |
| 13 | TJCJRQ | 成交日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 14 | TJBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

- (1)该库为相应席位当日每一证券的成交股数、资金及相关税费的一级净额数据,供证券营业部和券商法人做统计和对帐使用。该库同时也通过法人资金结算网络传送给券商法人。
- (2)该库不包含交易品种(如A股、B股、基金等)的总量统计数据。证券营业部和券商法人可根据证券代码(TJZQDM)的证券种类标识位(左端2位)自行统计。

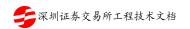


- (3) **TJXWDM**(字段1: 席位代码)、**TJZQDM**(字段2: 证券代码)两个字段为本接口库的关键字。
- (4) **TJBJSF**(字段 7: 买经手费)、**TJSJSF**(字段 8: 卖经手费)为交易所经手费和证券交易规费的合计金额。
- (5) **TJBGHF**(字段 11: 买过户费)、**TJSGHF**(字段 12: 卖过户费),该两字段对于创业板证券为过户费金额,对于B股证券为结算费金额,其他证券则为 0。

| 11. B 股结算指令库 SJSZL.dl | 11. | B | 股结 | 算指今 | -库 | SJSZL,db | f |
|-----------------------|-----|---|----|-----|----|----------|---|
|-----------------------|-----|---|----|-----|----|----------|---|

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|------|---------|
| 1 | ZLXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | ZLZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 3 | ZLGDDM | 证券账户 | С | 10 | |
| 4 | ZLGFXZ | 股份性质 | С | 2 | |
| 5 | ZLWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | |
| 6 | ZLYWLB | 业务类别 | С | 2 | |
| 7 | ZLJSRQ | 交收日期 | D | 8 | |
| 8 | ZLSFZL | 收付种类 | С | 3 | DEL/REC |
| 9 | ZLHKFS | 划款方式 | С | 2 | FP/AP |
| 10 | ZLCJJG | 成交价格 | N | 9,3 | |
| 11 | ZLWTJE | 委托金额 | N | 15,3 | |
| 12 | ZLDFXW | 对方席位 | С | 6 | |
| 13 | ZLDFDM | 对方账户 | С | 10 | |
| 14 | ZLDFXZ | 对方性质 | С | 2 | |
| 15 | ZLWTXH | 委托序号 | С | 8 | |
| 16 | ZLWTRQ | 委托日期 | D | 8 | |
| 17 | ZLTXBZ | 通信标志 | С | 1 | 通信公司用 |
| 18 | ZLBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) 本库为境外券商 B 股结算指令的上传接口库,二类指令通过该接口库报送。
- (2) ZLYWLB(字段 6:业务类别)为结算业务类别,二类指令的业务类别定义为'I2'。
- (3) ZLSFZL(字段 8:收付种类)在二类指令业务中,ZLSFZL='DEL'或'REC',其含义为:



'DEL'表示 ZLXWDM 代表的席位为交付方 'REC'表示 ZLXWDM 代表的席位为交收方

- (4) ZLHKFS(字段 9:划款方式)在二类指令业务中,ZLHKFS='AP'或'FP',其含义为:
 - 'AP'表示需要付款
 - 'FP'表示无需付款
 - (5) 对于二类指令业务,需要使用的字段有:

ZLXWDM,ZLZQDM,ZLGDDM,ZLWTSL,ZLJSRQ,ZLDFXW,ZLWTXH,ZLWTRQ,ZLYWLB,ZLSFZL,ZLHKFS。如果 ZLHKFS='AP',则还需要使用 ZLWTJE 字段。其它字段为预留字段,暂不使用。

12. B 股结算指令状态库 SJSZT.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|------|-----------|
| 1 | ZTXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | ZTZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 3 | ZTGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 4 | ZTGFXZ | 股份性质 | С | 2 | |
| 5 | ZTWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | |
| 6 | ZTYWLB | 业务类别 | C | 2 | 'I2'—二类指令 |
| 7 | ZTJSRQ | 交收日期 | D | 8 | |
| 8 | ZTSFZL | 收付种类 | C | 3 | DEL/REC |
| 9 | ZTHKFS | 划款方式 | C | 2 | FP/AP |
| 10 | ZTCJJG | 成交价格 | N | 9,3 | |
| 11 | ZTWTJE | 委托金额 | N | 15,3 | |
| 12 | ZTDFXW | 对方席位 | C | 6 | |
| 13 | ZTDFDM | 对方账户 | C | 10 | |
| 14 | ZTDFXZ | 对方性质 | C | 2 | |
| 15 | ZTWTXH | 委托序号 | C | 8 | |
| 16 | ZTWTRQ | 委托日期 | D | 8 | |
| 17 | ZTJCRQ | 检查日期 | D | 8 | |
| 18 | ZTZTBZ | 状态标志 | С | 40 | |
| 19 | ZTZYDH | 摘要代号 | С | 3 | 保留数据 |
| 20 | ZTBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

(1) 本库为境外券商B股结算指令状态库,用于返回券商报送的B股结算指令库(SJSZL.dbf)的检查结果。结算交收系统事先检查指令库数据项的正确性,并将



检查结果通过状态标志返回。本库不能用于交收。

- (2) 字段 1-16 为报送指令库的原内容。
- (3) ZTZTBZ(字段 18:状态标志), 内容如下:

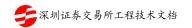
全空 表示指令已配对成功

- 1-2 位等于"70"表示没有与该指令配对的指令
- 1-2 位等于"71"表示股数不相配
- 3-4 位等于"72"表示付款类别不相配
- 5-6 位等于"73"表示付款金额不相配
- 7-8 位等于"74" 表示对手方不相配
- 9-10 位等于"51"表示证券代码无效
- 11-12 位等于"52"表示席位代码无效
- 13-14 位等于"53"表示证券账户无效
- 15-16 位等于"54"表示指令类别无效
- 17-18 位等于"55" 表示付款类别无效
- 19-20 位等于"56"表示对手方席位代码无效
- 21-22 位等于"57"表示席位代码等于对手方席位代码
- 23-24 位等于"58", 表示委托序号无效
- 25-26 位等于"59", 表示业务代号无效
- 27-28 位等于"60"、表示传送数据库无效
- 29-40 位等于空

13. 席位信息库 SJSXW.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|----|----------|
| 1 | XWJSXW | 结算席位代码 | С | 6 | |
| 2 | XWXWMC | 席位名称 | C | 42 | |
| 3 | XWXWLB | 席位类别 | C | 1 | |
| 4 | XWZTBZ | 转托管标志 | С | 1 | |
| 5 | XWFSRQ | 发送日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 6 | XWBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) 该库包含所有结算席位的信息,供券商为投资者办理转托管时使用。
- (2)XWXWLB(字段3:席位类别)用于表明该席位是A股席位或B股席位。



XWXWLB='A'表示 A 股席位;XWXWLB='B'表示 B 股席位; XWXWLB='L'表示 LOF 跨系统转托管专用的代销人编码; XWXWLB='X'表示信用交易专用席位。 对于同时有 A 股和 B 股业务的席位,在本库中有两条记录。

(3) **XWZTBZ**(字段 4: 转托管标志)为'Y'时,表示该席位可以做转托管; XWZTBZ 为'N'时,表示该席位不能做转托管。

14. 代理信息库 SJSDL.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|-------|----|----|----------|
| 1 | DLJJDM | 基金代码 | С | 6 | |
| 2 | DLJJJC | 基金简称 | C | 12 | |
| 3 | DLDLRH | 代销人编码 | C | 6 | |
| 4 | DLDLMC | 代销人名称 | C | 32 | |
| 5 | DLFSRQ | 发送日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 6 | DLBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

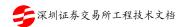
(1)该库包含所有代理销售 LOF 的代销人与 LOF 基金的代理信息,供券商 为投资者办理跨系统转托管时使用。

15. LOF 结算信息库 LOFJS.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|---------------|--------|----|------|----------|
| 1 | JSXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 2 | JSZQDM | 证券代码 | C | 6 | |
| 3 | JSGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 4 | JSYWLB | 业务类别 | C | 2 | |
| 5 | JSWTRQ | 委托日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 6 | JSWTXH | 委托序号 | C | 8 | 券商系统产生 |
| 7 | JSJSLS | 结算流水号 | N | 10,0 | TA 系统产生 |
| 8 | JSWTSL | 委托数量 | N | 16,2 | |
| 9 | JSQRSL | 确认数量 | N | 16,2 | |
| 10 | JSJJJZ | 基金单位净值 | N | 10,4 | |
| 11 | JSZJJE | 资金金额 | N | 16,2 | |
| 12 | JSZJJE1 | 资金金额 1 | N | 16,2 | |
| 13 | JSZJJE2 | 资金金额 2 | N | 16,2 | |
| 14 | JSZJJE3 | 资金金额 3 | N | 16,2 | |
| 15 | JSZJJE4 | 资金金额 4 | N | 16,2 | |
| 16 | JSZJJE5 | 资金金额 5 | N | 16,2 | |

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|---------------|--------|----|------|----------|
| 17 | JSZJJE6 | 资金金额 6 | N | 16,2 | |
| 18 | JSZJJE7 | 资金金额 7 | N | 16,2 | |
| 19 | JSZJJE8 | 资金金额 8 | N | 16,2 | |
| 20 | JSFHDM | 返回代码 | C | 4 | |
| 21 | JSGHRQ | 过户日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 22 | JSFSRQ | 发送日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 23 | JSBYZ1 | 备用字段1 | C | 6 | |
| 24 | JSBYZ2 | 备用字段 2 | С | 30 | |
| 25 | JSBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

- (1) 该库为通过深交所办理 LOF 业务的专用结算数据库,仅面向具有开放式基金代销业务资格的证券营业部使用。目前,该库仅包含 LOF 申购、赎回业务数据。
 - (2) 中国结算开放式基金登记结算系统,以下简称"TA系统"。
- (3) JSXWDM(字段 1: 席位代码)、JSZQDM(字段 2: 证券代码)、JSGDDM (字段 3: 证券账户)、JSYWLB(字段 4: 业务类别)、JSWTRQ(字段 5: 委托日期)和JSWTXH(字段 6: 委托序号)六个字段为该库的关键字。
 - (4) JSWTRQ (字段 5: 委托日期), 委托申报日期。
 - (5) JSWTXH (字段 6: 委托序号), 券商申报的合同序号最后 8 位。
- (6) JSJSLS (字段 7: 结算流水号), TA 系统产生的流水号, 若 TA 系统未填该字段,则为空。
- (7) JSJJJZ(字段 10: 基金单位净值),对于 LOF 申购赎回业务,表示委托申报日的基金单位净值,TA系统是据此进行份额和税费计算的。
- (8) JSZJJE1(字段 12: 资金金额 1)~ JSZJJE8(字段 19: 资金金额 8)表示各种资金和税费,因不同业务而有不同解释,其业务及费用含义见表十五。
- (9) JSFHDM(字段 20: 返回代码),详细解释请参见《中国证券登记结算公司开放式基金数据接口规范》中"交易处理返回代码的取值及含义"部分,该接口规范可从中国结算网站(www.chinaclear.cn)下载。
- (10) JSGHRQ(字段21: 过户日期),对于LOF 申购赎回业务,表示LOF份额的登记日期。
 - (11) JSFSRO (字段 22: 发送日期), 表示数据发送日期。
- (12) JSYWLB(字段 4: 业务类别),本字段的定义将决定 JSWTSL(字段 8: 委托数量)、JSQRSL(字段 9: 确认数量)与 JSZJJE(字段 11: 资金金额)的处理,详见表十六,其中"Y"表示可用于记账。



业务及费用含义表 (表十五)

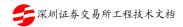
| JSYWLB | JSZJJE1 | JSZJJE2 | JSZJJE3 | JSZJJE 4 | JSZJJE 5 | JSZJJE 6 | JSZJJE 7 | JSZJJE 8 |
|--------|---------|---------|---------|----------|----------|--------------|----------|----------|
| L1 | 手续费 | 代理费 | 深交所经手费 | 过户费 | 印花税 | 退款 | 0 | 0 |
| L3 | 手续费 | 代理费 | 深交所经手费 | 过户费 | 印花税 | 归基金资产的 费用 | 0 | 0 |

说明:

- (1) 手续费是总费用, 手续费扣除其他各种费用后即是基金公司管理费;
- (2) 对于 TA 系统确认的 LOF 申购结果(JSYWLB=L1),基金公司管理费=手续费(JSZJJE1)—代理费(JSZJJE2)—深交所经手费(JSZJJE3)—过户费(JSZJJE4),委托申购金额(JSWTSL)=确认金额(JSZJJE)+退款(JSZJJE6);
- (3) 对于 TA 系统确认的 LOF 赎回结果(JSYWLB=L3), 基金公司管理费=手续费(JSZJJE1)—代理费(JSZJJE2)—深交所经手费 (JSZJJE3)—过户费(JSZJJE4)—归基金资产的费用(JSZJJE6), 赎回确认份额(JSQRSL)×委托申报日的基金单位净值(JSJJJZ)=实际应得金额(JSZJJE)+手续费(JSZJJE1)+印花税(JSZJJE5)。

LOF 业务类别含义表(表十六)

| JSYWLB | 相应业务含义 | JSZJJE | | JSWTSL | | | JSQRSL | | | |
|--------|-------------------|------------------------|----|--------|--------------------|----|--------|-----------------|----|---|
| L0 | LOF 申购无效委托。 | | =0 | | 申购委托金额, 单位是人民币元 | >0 | Y | | =0 | |
| L1 | TA 系统确认的 LOF 申购结果 | 确认金额,含手续费和印 花税 | ≥0 | Y | 申购委托金额, 单位是人民币元 | >0 | Y | 申购确认份额, 单位是份 | ≥0 | Y |
| L2 | LOF 赎回无效委托。 | | =0 | | 赎回委托份额, 单位是份 | >0 | Y | | =0 | |
| L3 | TA 系统确认的 LOF 赎回结果 | 扣除投资者的手续费和 印花税后应得资金 | ≥0 | 1 | 赎回委托份额, 单位是份 | >0 | Y | 赎回确认份额, 单位是份 | ≥0 | Y |

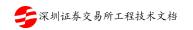


① L3 赎回资金的支付参照《中国结算开放式证券投资基金登记结算业务指南》的第七章——资金结算。

(http://www.chinaclear.cn/upload/attach/2003/11/1069225902825.files/1070798848210.doc)

注: LOF 申购/赎回业务返回数据说明: (T日为申请日)

| 日期 | 业务类别 JSYWLB | 说明 |
|-------|-----------------------|------------------------------------|
| ΤE | L0, LOF 申购无效委托 | 券商可据此解冻投资者的资金。 |
| | L2, LOF 赎回无效委托 | 券商可据此解冻投资者的份额。 |
| T+1 日 | L1, TA 系统确认的 LOF 申购结果 | 券商可据此记加投资者的份额,并向投资者退款。 |
| | L3, TA 系统确认的 LOF 赎回结果 | 对于份额,券商可据此记减投资者的份额; |
| | | 对于资金,因基金管理人尚未支付赎回款,券商不要向投资者支付赎回资金。 |



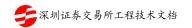
四、 资金结算接口规范

本部分接口规范包括资金清算库(SJSQS.dbf)和资金结算信息库(SJSZJ.dbf)。结算公司每个交易日将以上接口库传送给券商法人指定的席位,同时也通过法人资金结算网络传送给境内券商法人。

16. 资金清算库 SJSQS.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|----------|
| 1 | QSYWLB | 业务类别 | С | 2 | |
| 2 | QSMXZH | 明细账号 | С | 10 | |
| 3 | QSZQDH | 证券代码 | С | 6 | |
| 4 | QSXWDM | 席位代码 | С | 6 | 股份托管席位 |
| 5 | QSJSXW | 结算席位 | С | 6 | 资金结算主席位 |
| 6 | QSSFJE | 收付金额 | N | 17,2 | |
| 7 | QSMRJE | 买入金额 | N | 17,2 | |
| 8 | QSMCJE | 卖出金额 | N | 17,2 | |
| 9 | QSDYHS | 代征印花税 | N | 17,2 | |
| 10 | QSJGGF | 监管规费 | N | 17,2 | |
| 11 | QSJFXJ | 结算风险金 | N | 17,2 | |
| 12 | QSJSSF | 结算收费 | N | 17,2 | |
| 13 | QSJGHF | 过户费 | N | 17,2 | |
| 14 | QSJJSF | 交易经手费 | N | 17,2 | |
| 15 | QSQSXF | 券商手续费 | N | 17,2 | |
| 16 | QSZJE1 | 资金金额 1 | N | 17,2 | 保留字段 |
| 17 | QSZJE2 | 资金金额 2 | N | 17,2 | 保留字段 |
| 18 | QSZJE3 | 资金金额 3 | N | 17,2 | 保留字段 |
| 19 | QSCJRQ | 成交日期 | D | | CCYYMMDD |
| 20 | QSQSRQ | 清算日期 | D | | CCYYMMDD |
| 21 | QSJSRQ | 交收日期 | D | | CCYYMMDD |
| 22 | QSFSRQ | 发送日期 | D | | CCYYMMDD |
| 23 | QSBYZ1 | 备用字段1 | С | 12 | 保留字段 |
| 24 | QSBYZ2 | 备用字段 2 | С | 6 | 保留字段 |
| 25 | QSBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

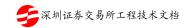
- (1) 本库用于 DVP 产品的资金清算,于交收前一工作日发送给券商,券商应据此完成资金交收。
- (2) 根据不同业务类别,定义不同字段的含义。具体清算业务含义详见表十七。



- (3) ZJMXZH(字段 2: 明细帐号)为会员在结算公司开设的资金结算帐号, 帐号左四位表示资金结算帐号的资金性质和货币种类, 右六位是资金结算席位代号。A 股人民币备付金帐号的左四位为'B001', B 股港币备付金帐号的左四位为'B201';
- (4) QSZQDH(字段 3, 证券代码), 指该笔资金发生所涉及的证券代码。有的资金发生是按证券类别(定义见本规范表一)统计记帐的,则本字段左边第一、二位标识证券类别,随后补空格。当有的资金发生并不涉及证券代码时,则本字段为空格。
- (5) 所有资金字段(字段6~18),如果大于零,则表示该结算参与人应收资金,否则表示应付资金。
- (6) QSSFJE(字段 6, 收付金额)=其余资金字段的代数和(字段 7~18)。 结算参与人可据此对每条记录进行稽核。
 - (7) QSCJRQ(字段19,成交日期)表示委托日期。
- (8) QSQSRQ(字段 20, 清算日期)表示清算处理的日期。如果是 T+1 交收,则 QSCJRQ=QSQSRQ,即 T 日是清算日。
- (9) QSZJJE1、QSZJJE2、QSZJJE3(字段 16、17、18,资金金额 1、2、3), QSBYZ1、QSBYZ2(字段 23、24,备用字段 1、2):目前为结算公司保留字段, 以便以后根据新业务进行定义。结算参与人不要自行使用以上字段进行处理。
 - (10) QSBYBZ(字段 25, 备用标志): 专门提供给券商系统自行使用。 清算业务含义表(表十七)

| JSYWLB | 相应业务含义 | 说明 |
|--------|----------------|-------------------------|
| 00 | 交易清算数据 | QSZQDH 为证券类别: |
| | | '03',表示权证类别的交易清算; |
| | | 'EF',表示 ETF 的交易清算。 |
| | | 成交日期=清算日期,交收日期=清算日期+1。 |
| | | 买入金额表示买入成交应付资金,卖出金额表示卖出 |
| | | 成交应收资金。 |
| W1 | 以现金方式结算的认沽权 | QSZQDH 为权证代码 |
| | 证清算数据 | 成交日期=清算日期,交收日期=清算日期+1。 |
| W2 | 以证券给付方式结算的认 | 买入金额表示行权应付资金,卖出金额表示行权应收 |
| | 沽权证清算数据 | 资金。 |
| W3 | 以现金方式结算的认购权 | |
| | 证清算数据 | |

深圳证券交易所

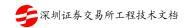


| JSYWLB | 相应业务含义 | 说明 |
|--------|----------------|-----------------------------|
| W4 | 以证券给付方式结算的认 | |
| | 购权证清算数据 | |
| L4 | ETF 申购 | QSZQDH 为 ETF 证券代码。 |
| | | 1、成交日期=清算日期,交收日期=清算日期+1。 |
| | | 买入金额表示现金替代资金。 |
| | | 2、成交日期=清算日期-1,交收日期=清算日期+1。本 |
| | | 记录为上个交易日申购业务相关的税费。 |
| L5 | ETF 赎回 | QSZQDH 为 ETF 证券代码。 |
| | | 1、成交日期=清算日期,交收日期=清算日期+1。 |
| | | 卖出金额表示现金替代资金。 |
| | | 2、成交日期=清算日期-1,交收日期=清算日期+1。本 |
| | | 记录为上个交易日赎回业务相关的税费。 |
| L7 | T-1 日 ETF 现金差额 | QSZQDH 为 ETF 证券代码 |
| | | 成交日期=清算日期-1,清算日期为当日,交收日期= |
| | | 清算日期+1。 |
| | | 买入金额为申购现金差额,卖出金额为赎回现金差额。 |
| L8 | ETF 现金替代的多退少补 | QSZQDH 为 ETF 证券代码 |
| | | 成交日期为空,清算日期为当日,交收日期=清算日期 |
| | | +1。 |
| | | 买入金额为补款金额,卖出金额表示退款金额。 |

17. 资金结算信息库 SJSZJ.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|----------|
| 1 | ZJMXZH | 明细帐号 | С | 10 | |
| 2 | ZJYTDH | 用途代号 | C | 4 | |
| 3 | ZJPZHM | 凭证号码 | N | 10,0 | |
| 4 | ZJFSJE | 发生金额 | N | 17,2 | |
| 5 | ZJDQYE | 当前余额 | N | 17,2 | |
| 6 | ZJXWDM | 发生席位代码 | С | 6 | |
| 7 | ZJZQDM | 发生证券代码 | C | 6 | |
| 8 | ZJJZRQ | 交收日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 9 | ZJBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

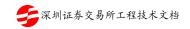
- (1) 资金结算信息库用于资金交收对账。此外,还包括B股试交收数据。
- (2) **ZJMXZH**(字段 1: 明细帐号)为会员在结算公司开设的资金结算帐号,帐号左四位表示资金结算帐号的资金性质和货币种类,右六位是资金结算席位代号。A股人民币备付金帐号的左四位为'B001',B股港币备付金帐号的左四位为'B201',人民币开放式基金业务备付金帐号的左四位为'B401'。



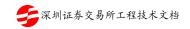
- (3) **ZJYTDH**(字段 2: 用途代号)给出了发生金额(**ZJFSJE**)的原因或出处,当前定义的数据集见表八(见后页)。
- (4) **ZJPZHM**(字段 3: 凭证号码),这是结算公司资金记帐系统所用的流水号,与券商资金系统无关。当券商需要向结算公司资金交收部询问相关记录时,告知该凭证号码即可。对 B 股资金试交收数据,该字段填入特殊值-1,券商应该据此准备在资金交收日(ZJJZRQ)向结算公司付款或收款,并应注意与资金正式交收数据区别处理。
- (5) ZJFSJE(字段 4: 发生金额)和 ZJDQYE(字段 5: 当前余额),其中发生金额(ZJFSJE)表示在当前明细帐号(ZJMXZH)中发生的一笔收付款项,大于零时表示应收结算公司款,小于零则表示应付结算公司款;ZJDQYE表示当前明细帐号 ZJMXZH中记入发生金额 ZJFSJE后的余额。本库中某个明细帐号 ZJMXZH在交收日 ZJJZRQ 的最后一条记录的当前余额(ZJDQYE)才是该明细帐号(ZJMXZH)的当日余额。结算公司和券商之间实行净额交收。对境外 B 股券商,本库中当前交收日的最后一条试交收记录的当前余额(ZJDQYE)小于零时表示应付结算公司款,付款净额为当前余额(ZJDQYE)的绝对值;当前余额(ZJDQYE)大于零时表示应收结算公司款,应收额为所有试交收记录发生金额(ZJFSJE)的合计数。
- (6) **ZJXWDM**(字段 6: 发生席位代码)指发生了该笔资金帐的券商下属证券营业部席位代码。
- (7) **ZJZQDM**(字段 7: 发生证券代码)指该笔资金发生所涉及的证券代码。有的资金发生是按证券类别(定义见本规范表一,ETF 的证券类别为 EF)统计记帐的,则本字段左边第一、二位标识证券类别,随后补空格。当有的资金发生并不涉及证券代码时,则本字段为空格。

| | 用途代 | 号含义表 | (表八) |
|--|-----|------|------|
|--|-----|------|------|

| ZJYTDH | 资金用途描述 | ZJZQDM |
|--------|-----------------------|--------------|
| A001 | 结算头寸调出或头寸存入 | 空格 |
| A201 | B股结算头寸调出或头寸存入 | 空格 |
| B001 | 结算头寸内转 | 空格 |
| B002 | 结算保证金调整 | 空格 |
| B003 | 因股份卖空而冻结资金或补购后资金解冻 | 证券代码 |
| | 债券质押库欠库而冻结的资金或补库后资金解冻 | 131990 (国债) |
| | | 131991 (企业债) |
| B006 | 权证交收履约保证金 | 空格 |



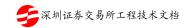
| ZJYTDH | 资金用途描述 | ZJZQDM |
|--------|------------------------|---------|
| B008 | ETF 申购赎回交收履约保证金 | 空格 |
| B201 | B股结算头寸内转 | 空格 |
| B202 | B股结算保证金调整 | 空格 |
| B203 | 因B股股份卖空而冻结资金或补购后资金解冻 | 证券类别 |
| B204 | B股卖空赢余 | 空格 |
| C001 | 主板买、卖净额(A股) | 证券类别 |
| C002 | 主板买、卖净额 (国债) | 证券类别 |
| C003 | 主板买、卖净额 (基金) | 证券类别、EF |
| C004 | 主板上网发行新股申购资金 | 证券代码 |
| C006 | 市值配售股票买、卖净额 | 0S |
| C007 | 权证买、卖净额 | 证券类别 |
| C008 | 集中资金交收 (ETF 申购赎回) | 证券代码 |
| C101 | 创业板买、卖净额 | 证券类别 |
| C104 | 创业板上网发行新股申购资金 | 证券代码 |
| C201 | B股买、卖净额 | 证券类别 |
| C204 | B股上网发行新股申购资金 | 证券代码 |
| C401 | 开放式基金申购、赎回净额 | 证券代码 |
| C402 | 开放式基金发行认购 | 证券代码 |
| D001 | 主板 A 股派息 | 证券代码 |
| D002 | 主板基金派息 | 证券代码 |
| D003 | 主板国债兑付 | 证券代码 |
| | 从质押库转出的债券时发放的已派息金额或已兑付 | 证券代码 |
| | 本息金额 | |
| D004 | 主板零债资金 | 证券代码 |
| D005 | 市值配售股票派息 | 证券代码 |
| D006 | 收购资金 | 证券代码 |
| D101 | 创业板派息 | 证券代码 |
| D201 | B股派息 | 证券代码 |
| D401 | 开放式基金权益分派 | 证券代码 |
| E001 | 主板配股认购资金 | 证券代码 |
| E002 | 主板上网发行新股认购资金 | 证券代码 |
| E003 | LOFs/ETFs 发行认购资金 | 证券代码 |
| E101 | 创业板配股认购资金 | 证券代码 |
| E102 | 创业板上网发行新股认购资金 | 证券代码 |
| E201 | B股配股认购资金 | 证券代码 |
| E202 | B股上网发行新股认购资金 | 证券代码 |
| F001 | 暂收结算款项 | 空格 |
| F201 | 暂收B股结算款项 | 空格 |
| G001 | 主板印花税 | 证券类别 |



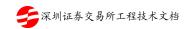
| ZJYTDH | 资金用途描述 | ZJZQDM |
|--------|-----------------|---------|
| G002 | 主板监管规费(A股) | 证券类别 |
| G003 | 主板监管规费 (投资基金) | 证券类别、EF |
| G004 | 市值配售股票交易印花税 | 0S |
| G005 | 市值配售股票监管规费 | 0S |
| G006 | 收购印花税 | 证券代码 |
| G007 | 收购监管规费 | 证券代码 |
| G008 | 继承等非交易过户印花税 | 证券代码 |
| G009 | 债券交易监管规费 | 证券类别 |
| G010 | 权证交易印花税 | 证券类别 |
| G011 | 权证交易监管规费 | 证券类别 |
| G012 | ETF 申购赎回监管规费 | 证券代码 |
| G101 | 创业板印花税 | 证券类别 |
| G102 | 创业板监管规费 | 证券类别 |
| G201 | B股印花税 | 证券类别 |
| G202 | B股监管规费 | 证券类别 |
| G203 | B股(公众股)非交易过户印花税 | 空格 |
| G401 | 开放式基金印花税 | 证券代码 |
| G402 | 开放式基金监管规费 | 证券代码 |
| H001 | 主板交易经手费(A股) | 证券类别 |
| H002 | 主板交易经手费 (国债) | 证券类别 |
| H003 | 主板交易经手费 (基金) | 证券类别 |
| H004 | 主板新股发行手续费 | 证券代码 |
| H005 | 主板配股手续费 | 证券代码 |
| H006 | 转托管手续费 | 空格 |
| H007 | 主板国债兑付手续费 | 证券代码 |
| H008 | 主板新股登记费 | 证券代码 |
| H009 | 主板配股登记费 | 证券代码 |
| H010 | 主板派息手续费 | 证券代码 |
| H011 | 主板实时开户费 | 空格 |
| H016 | 席位管理年费 | 空格 |
| H017 | 股份质押收费 | 空格 |
| H018 | 卫星信道费 | 空格 |
| H019 | 市值配售股票交易经手费 | 0S |
| H020 | 市值配售股票配股手续费 | 证券代码 |
| H021 | 市值配售股票发行手续费 | 证券代码 |
| H023 | 收购经手费 | 证券代码 |
| H024 | 收购过户费 | 证券代码 |
| H025 | 收购保管费 | 证券代码 |
| H026 | 代扣上市公司费用 | |



| ZJYTDH | 资金用途描述 | ZJZQDM |
|--------|-------------------|--------|
| H029 | LOFs/ETFs 发行认购手续费 | 证券代码 |
| H031 | 权证交易经手费 | 证券类别 |
| H032 | 权证交易结算费 | 证券类别 |
| Н033 | 权证行权股票过户费 | 证券代码 |
| H034 | 权证行权结算费 | 证券代码 |
| H036 | ETF 申购赎回经手费 | 证券代码 |
| Н037 | ETF 组合证券过户费 | 证券代码 |
| H104 | 创业板新股发行手续费 | 证券代码 |
| H105 | 创业板配股手续费 | 证券代码 |
| H108 | 创业板新股登记费 | 证券代码 |
| H109 | 创业板配股登记费 | 证券代码 |
| H110 | 创业板派息手续费 | 证券代码 |
| H111 | 创业板实时开户费 | 空格 |
| H112 | 创业板股份结算费 | 证券类别 |
| H201 | B股交易经手费 | 证券类别 |
| H204 | B股新股发行手续费 | 证券代码 |
| H205 | B股配股手续费 | 证券代码 |
| H206 | B股转托管手续费 | 空格 |
| H207 | B股 SI2 转托管费 | 空格 |
| H208 | B股新股登记费 | 证券代码 |
| H209 | B股配股登记费 | 证券代码 |
| H210 | B股派息手续费 | 证券代码 |
| H211 | B股实时开户费 | 空格 |
| H212 | B股非交易过户手续费 | 空格 |
| H213 | B股股份调帐费 | 空格 |
| H217 | B股股份质押登记手续费 | 空格 |
| H221 | B股股份结算费 | 证券类别 |
| H222 | B股柜台账户代理费 | 空格 |
| H401 | 开放式基金申购过户费 | 证券代码 |
| H402 | 开放式基金赎回过户费 | 证券代码 |
| H403 | 开放式基金红利再投资过户费 | 证券代码 |
| H404 | 开放式基金发行认购过户费 | 证券代码 |
| H406 | 开放式基金转托管费 | 证券代码 |
| H410 | 开放式基金红利手续费 | 证券代码 |
| I001 | 主板结算风险基金 | 证券类别 |
| I002 | 主板结算公司风险基金 | 证券类别 |
| I003 | 市值配售股票结算风险基金 | 0S |
| 1005 | 收购结算风险基金 | 证券代码 |
| I007 | 权证结算风险基金 | 证券类别 |



| ZJYTDH | 资金用途描述 | ZJZQDM |
|--------|--------------------|--------|
| 1008 | ETF 申购赎回结算风险基金 | 证券代码 |
| I101 | 创业板结算风险基金 | 证券类别 |
| I102 | 创业板交易所风险基金 | 证券类别 |
| I201 | B股结算风险基金 | 证券类别 |
| I202 | B股结算公司风险基金 | 证券类别 |
| I401 | 开放式基金结算风险基金 | 证券代码 |
| J001 | 会员结算头寸利息 | 空格 |
| J002 | 卖空冻结利息 | 空格 |
| J007 | 透支罚息 | 空格 |
| J009 | 卖空违约金 | 证券代码 |
| | 欠库罚款 | 空格 |
| J010 | 权证交收履约保证金利息 | 空格 |
| J011 | 行权专用资金交收账户利息 | 空格 |
| J012 | ETF 申购赎回交收履约保证金利息 | 空格 |
| J201 | B股会员结算头寸利息 | 空格 |
| J202 | B股卖空冻结利息 | 空格 |
| J207 | B股透支罚息 | 空格 |
| J208 | B股卖空罚款 | 空格 |
| J401 | 开放式基金结算备付金、保证金利息收支 | 证券代码 |
| J403 | 开放式基金管理人费用帐户利息 | 证券代码 |
| J404 | 开放式基金发行认购款利息 | 证券代码 |
| J407 | 开放式基金结算备付金帐户透支罚息 | 证券代码 |
| K002 | 印花税退税 | 空格 |
| L001 | ETF 现金替代的多退少补 | 证券代码 |
| L401 | 开放式基金管理人费用 | 证券代码 |
| N001 | 发行人行权专用资金 | 证券代码 |



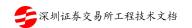
五、 开户登记接口规范

本规范描述开户代理机构(简称:开户点)柜台系统同结算公司开户系统之间的数据接口库,包括开户委托库(SJSKW.dbf)、开户回报库(SJSKB.dbf)、开户统计库(SJSKT.dbf)三个数据库。本部分规范仅适用于结算公司授权的开户代理机构。库中的文字编码要求:中文编码 GBK 规范,西文 ASCII 码。

18. 开户委托库 SJSKW.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|-----------|----|-----|----------|
| 1 | KWKHDH | 开户点代号 | С | 6 | |
| 2 | KWGDDM | 证券账户 | C | 10 | 数字字符串 |
| 3 | KWGDXM | 股东姓名/单位全称 | C | 60 | |
| 4 | KWSFZH | 身份证号/注册号码 | C | 30 | |
| 5 | KWYWDH | 业务代号 | C | 2 | |
| 6 | KWKHLB | 开户类别 | C | 1 | |
| 7 | KWGDXZ | 股东性质 | C | 2 | |
| 8 | KWTXDZ | 通信地址 | C | 108 | |
| 9 | KWYZBM | 邮政编码 | C | 22 | |
| 10 | KWGJDM | 国家和地区代码 | C | 3 | |
| 11 | KWDHHM | 电话号码 | C | 20 | |
| 12 | KWCZHM | 传真号码 | C | 20 | |
| 13 | KWZJLB | 证件类别 | C | 1 | |
| 14 | KWWTRQ | 委托日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 15 | KWWTXH | 委托序号 | C | 8 | 数字字符串 |
| 16 | KWCLBZ | 处理标志 | C | 1 | |
| 17 | KWBYBZ | 备用标志 | C | 1 | 开户点自用 |

- (1) 通过本接口库,开户点将投资者开户、更改股东资料、股东资料查询、合并代码卡、注销代码卡、代码卡挂失补办等业务委托数据实时传送给结算公司。
- (2) **KWGDDM**(字段 2: 证券账户),证券账户由 10 位数字字符组成,不足则左端补足'0'。
- (3) KWGDXM(字段 3: 股东姓名/单位全称),个人为股东姓名,机构为单位全称。从左至右连续填写,右端不足部分填空格。A股、基金、B股的股东姓名最多不超过7个汉字或14个半角英文字符,不少于2个汉字或4个半角英文字符;单位全称最多不超过30个汉字或60个半角英文字符,不少于4个汉字或8个半角英文字符。

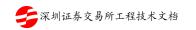


- (4) KWSFZH(字段4:身份证号/注册号码),个人为身份证或护照号码, 机构为注册号码。从左到右连续填写,不足则右面补足空格。国家和地区代码为 "CHN"的身份证号码按公安部的标准进行校验。
- (5) KWYWDH(字段5:业务代号),用以标识本库相应记录的业务类别, 其值域定义见表九。表中的"业务字段"是指除"关键字段"外的其它字段(字段 KWWTRQ、KWWTXH、KWCLBZ对于每条记录都应填入规定值)。凡与某项 业务相关的"业务字段",都应按相应字段的要求填入正确数据,不相关的字段一 律填空格。

| KWYWDH | 业务描述 | 关键字段 | 业务字段 | 备注 |
|--------|----------|---------------|--------------|------------------|
| 10 | m 大 正 À | KWSFZH | 除KWGDDM外的 | |
| 10 | 股东开户 | KWGDXM | 其余字段 | |
| | | KWGDDM | KWTXDZ 从右到 | |
| 11 | 合并证券账户 | KWSFZH | 左存放合并后的证 | |
| | | KWGDXM | 券账户 | |
| | | KWGDDM | | |
| 12 | 注销证券账户 | KWSFZH | 无 | |
| | | KWGDXM | | |
| | | KWGDDM | | |
| 13 | 挂失补办不换号 | KWSFZH | 无 | |
| | | KWGDXM | | |
| | | KWGDDM | | |
| 14 | 挂失补办换新号 | KWSFZH | 无 | |
| | | KWGDXM | | |
| | 五七叽七次州台 | KWGDDM | | |
| 15 | 更改股东资料第 | KWSFZH | 无 | 连续两笔委托的 |
| | 一笔委托 | KWGDXM | | |
| | 西妆叽大次划然 | | 需更改的业务字段 | KWGDDM 值必 须相等 |
| 16 | 更改股东资料第一 | KWGDDM | 填入相应值, 否则 | 沙 伯守 |
| | 二笔委托 | | 填空格 | |
| 17 | | KWGDDM | 无 | |
| | 股东资料查询 | KWSFZH | 九 | |
| | | KWGDDM | KWTXDZ 前 6 位 | |
| 18 | 开通网络服务 | KWSFZH | , , , , | |
| | | KWGDXM | 为初始密码 | |

开户委托业务代号含义表 (表九)

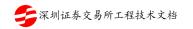
(6) KWKHLB(字段 6: 开户类别), '0'个人A股账户; '1'机构A股账户; '2'个人基金账户; '3'机构基金账户; '4'个人B股账户; '5'机构B股账户; '6' 个人专用债券账户(预留); '7'机构专用债券账户; '8'个人信用证券账户; '9'机构信用证券账户。所有业务必须填写本字段。



(7) KWGDXZ (字段 7: 股东性质), 其数据集定义见表十。

开户股东性质定义表 (表十)

| KWKHLB | KWGDXZ | 股东性质 |
|------------|--------|---------------------|
| 0, 2, 4, 6 | 空格 | 个人 |
| 1, 3, 7 | 61 | 综合类证券公司(上市) |
| | 62 | 综合类证券公司(非上市) |
| | 63 | 经纪类证券公司(上市) |
| | 64 | 经纪类证券公司(非上市) |
| | 65 | 银行(上市) |
| | 66 | 银行(非上市) |
| | 67 | 信托投资公司(上市) |
| | 68 | 信托投资公司(非上市) |
| | 69 | 封闭式证券投资基金(上市) |
| | 70 | 封闭式证券投资基金(非上市) |
| | 71 | 开放式证券投资基金 |
| | 72 | 其它证券投资基金(上市) |
| | 73 | 其它证券投资基金(非上市) |
| | 74 | 基金管理公司 |
| | 75 | 社保基金 |
| | 76 | 保险公司(上市) |
| | 77 | 保险公司(非上市) |
| | 78 | 其他金融机构(上市) |
| | 79 | 其他金融机构(非上市) |
| | 85 | 国有企业(上市) |
| | 86 | 国有企业(非上市) |
| | 87 | 非国有企业(上市) |
| | 88 | 非国有企业(非上市) |
| | 89 | 中外合资、合作企业(上市) |
| | 90 | 中外合资、合作企业(非上市) |
| | 91 | 中外合资、合作企业(国有控股、上市) |
| | 92 | 中外合资、合作企业(国有控股、非上市) |
| | 93 | 外商独资企业 |
| | 94 | 事业法人 |
| | 95 | 社团法人 |
| | 96 | 机关法人 |
| 5 | 50 | 境外基金 |
| | 51 | 境外证券公司 |
| | 52 | 境外代理人 |
| | 53 | 境外一般机构 |
| | 54 | 境外银行 |
| | 55 | 境外保险公司 |



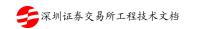
(8) **KWTXDZ**(字段 8: 通信地址)。在股东开户(**KWYWDH=**'10')业务中表示通信地址,从左向右连续存放 108 位字符。最多 54 个汉字或全角英文字符,右面不足部分补足空格。A 股、基金账户最多 60 位字符,B 股账户可以长达 108 位字符。国家和地区代码为"CHN"时,该字段应使用中文填写。

在合并证券账户(KWYWDH='11')业务中存放合并后的有效证券账户,从 右向左连续存放,左面不足部分补足空格。

- (9) KWYZBM (字段 9: 邮政编码),从左向右连续存放,右端不足部分填空格。
- (10) **KWGJDM**(字段 10: 国家和地区代码),国家和地区英文名称简写, 3位字母,例如中国为 CHN。国家和地区代码定义见表十四。
 - (11) KWDHHM (字段 11: 电话号码), 区号和电话号码中间用'-'连接。
 - (12) **KWCZHM** (字段 12: 传真号码), 同电话号码。
- (13) **KWZJLB**(字段 13: 证件类别), '0'居民身份证; '1'企业法人营业执照或注册登记证书; '9'护照; '7'其它证件。
- (14) **KWWTXH**(字段 15: 委托序号), 开户点柜台系统产生的委托流水序号, 左端不足部分填'0', 同一天内流水序号不得重复。
- (15) **KWCLBZ**(字段 16: 处理标志),表明本委托记录的处理状态,开户点柜台系统须将其置为小写字母'z'。通信程序将对该笔委托进行合法性检查,如合法则将其传送给结算公司主机,同时将 **KWCLBZ**字段置为'1',非法则被置为对应的错误代号(见表十一)。

| 开户委托错误代号含义表 (表十 | - -) |) |
|-----------------|--------------|---|
|-----------------|--------------|---|

| KWHFBZ | 错误代号含义 |
|--------|------------------------------|
| 'A' | 无效开户点代号(KWKHDH) |
| 'B' | 证券账户(KWGDDM)含有数字字符或空格之外的非法字符 |
| 'C' | 无效股东姓名/单位全称(KWGDXM) |
| 'D' | 无效通信地址(KWTXDZ) |
| 'E' | 邮政编码(KWYZBM)含非法字符 |
| 'F' | 委托日期(KWWTRQ)与传送日期不同 |
| 'G' | 业务代号(KWYWDH)含有数字字符之外的非法字符 |
| 'H' | 开户类别(KWKHLB)为非本规范定义的数据集 |
| 'K' | 处理标志(KWCLBZ)不等于小写字母'z' |



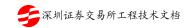
19.开户回报库 SJSKB.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|-----------|----|-----|----------|
| 1 | КВКНОН | 开户点代号 | С | 6 | |
| 2 | KBGDDM | 证券账户 | C | 10 | 数字字符串 |
| 3 | KBGDXM | 股东姓名/单位全称 | С | 60 | |
| 4 | KBSFZH | 身份证号/注册号 | С | 30 | |
| 5 | KBYWDH | 业务代号 | С | 2 | |
| 6 | KBKHLB | 开户类别 | С | 1 | |
| 7 | KBGDXZ | 股东性质 | С | 2 | |
| 8 | KBTXDZ | 通信地址 | С | 108 | |
| 9 | KBYZBM | 邮政编码 | С | 22 | |
| 10 | KBGJDM | 国家和地区代码 | С | 3 | |
| 11 | KBDHHM | 电话号码 | С | 20 | |
| 12 | KBCZHM | 传真号码 | С | 20 | |
| 13 | KBZJLB | 证件类别 | С | 1 | |
| 14 | KBZYDH | 摘要代号 | С | 3 | |
| 15 | KBHBRQ | 回报日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 16 | KBWTXH | 委托序号 | С | 8 | 数字字符串 |
| 17 | KBBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 开户点自用 |

- (1) 本接口库中所有字段的定义与 SJSKW.dbf(开户委托库)对应字段(字段名右四位字符相同)的定义相同。
- (2) 对于不同委托业务,本库的回报记录亦有所不同,以字段 KBYWDH (字段 5: 业务代号)的值来界定所使用的有效字段(见表十二),未使用到的字段一律为空格(KBKHDH、KBZYDH、KBHBRQ、KBWTXH 对于每条回报记录都有值)。

开户回报业务代号含义表 (表十二)

| KBYWDH | 业务描述 | 有效字段 | 备注 |
|--------|---------|---------|-----------------|
| 10 | 股东开户 | 所有字段都有效 | KBGDDM 为开出的证券账户 |
| 11 | 合并证券账户 | KBGDDM | KBTXDZ 中存放合并后的有 |
| | | KBSFZH | 效证券账户 |
| | | KBGDXM | |
| | | KBTXDZ | |
| 12 | 注销证券账户 | KBGDDM | |
| | | KBSFZH | |
| | | KBGDXM | |
| 13 | 挂失补办不换号 | KBGDDM | |
| | | KBSFZH | |



| KBYWDH | 业务描述 | 有效字段 | 备注 |
|--------|---------|---------|-------------------|
| | | KBGDXM | |
| 14 | 挂失补办换新号 | KBGDDM | 新证券账户在 KBGDDM 中 |
| | | KBGDXM | |
| | | KBSFZH | |
| 16 | 更改股东资料 | 所有字段都有效 | |
| 17 | 查询股东资料 | 所有字段都有效 | |
| 18 | 开通网络服务 | KBGDDM | KBTXDZ 前 6 位为初始密码 |
| | | KBSFZH | |
| | | KBGDXM | |

- (3) 当 **KBWTXH**(字段 16: 委托序号)等于-2 时,表示当天实时开户业务结束,结算公司主机不再接受开户委托。
- (4) 字段 **KBZYDH**(字段 14: 摘要代号)值为结算公司主机对开户委托的处理结果代号,其含义如表十三。

开户回报摘要代号含义表 (表十三)

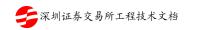
| KBZYDH | 含义 |
|--------|------------------|
| 空格 | 所申报的委托成功 |
| K21 | 无此开户点/开户点无权限 |
| K22 | 股东姓名/单位全称错 |
| K23 | 身份证号/注册号码无效 |
| K24 | 通信地址错 |
| K25 | 邮政编码错 |
| K26 | 电话号码错/传真号码错 |
| K27 | 股东性质错 |
| K28 | 该身份证/注册号码已开户 |
| K29 | 该身份证/注册号码不允许开户 |
| K30 | 无此证券账户/此股东未开户 |
| K31 | 股东还有股份/股息,不能注销 |
| K32 | 两账户身份证/注册号码不一致 |
| K33 | 证券账户与身份证、股东姓名不匹配 |
| K34 | 不同类型的账户不能合并 |
| K35 | 委托序号重复,委托无效 |
| K36 | 无效业务代号 |
| K37 | 证券账户已注销 |
| K38 | 证件类别无效 |
| K39 | 此项业务暂停使用 |
| K40 | 其他 |
| K42 | 国家和地区代码无效 |



20. 开户统计库 SJSKT.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|-------|----|------|-------------|
| 1 | KTKHDH | 开户点代号 | С | 6 | |
| 2 | KTYWDH | 业务代号 | C | 2 | |
| 3 | KTKHLB | 开户类别 | С | 1 | |
| 4 | KTKHSL | 开户数量 | N | 12,0 | |
| 5 | KTKHSF | 开户费 | N | 15,2 | |
| 6 | KTYSJK | 应缴款 | N | 15,2 | |
| 7 | KTKHRQ | 开户日期 | D | 8 | CCYYMMDD |
| 8 | KTJSFS | 结算方式 | C | 1 | 'R'日结;'Y'月结 |
| 9 | KTBYBZ | 备用标志 | С | 1 | 开户点自用 |

- (1) 此库在每个工作日/每月月末开户业务结束后传送给开户点。
- (2) KTKHDH、KTYWDH、KTKHLB 分别同开户委托库的 KWKHDH、 KWYWDH、KWKHLB 字段的定义相同。
- (3) KTKHSL (字段 4: 开户数量) 为该开户点当日 (KTJSFS='R') 或当 月(KTJSFS='Y')某类开户(KTKHLB)的有效笔数。



国家和地区代码定义 (表十四)

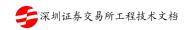
| 代码 | 国家和地区中文名称 |
|-----|-----------|
| ALB | 阿尔巴尼亚 |
| ARE | 阿拉伯联合酋长国 |
| ARG | 阿根廷 |
| AUS | 澳大利亚 |
| AUT | 奥地利 |
| BEL | 比利时 |
| BFA | 布基纳法索 |
| BGD | 孟加拉 |
| BGR | 保加利亚 |
| BHS | 巴哈马 |
| BIH | 波黑 |
| BLZ | 伯利兹 |
| BMU | 百慕大 |
| BOL | 玻利维亚 |
| BRA | 巴西 |
| BRB | 巴巴多斯 |
| BRN | 文莱 |
| BTN | 不丹 |
| BWA | 博茨瓦纳 |
| CAN | 加拿大 |
| CHE | 瑞士 |
| CHL | 智利 |
| CHN | 中国 |
| CMR | 喀麦隆共和国 |
| COG | 刚果共和国 |
| COK | 库克岛 |
| COL | 哥伦比亚 |
| CPV | 佛得角 |
| CRI | 哥斯达黎加 |
| CTN | 台湾 |
| CYM | 开曼群岛 |
| CYP | 塞浦路斯 |
| CZE | 捷克 |
| DEU | 德国 |
| DNK | 丹麦 |
| DOM | 多米尼加 |
| ECU | 厄瓜多尔 |
| EGY | 埃及 |

| 代码 | 国家和地区中文名称 |
|-----|-----------|
| ERI | 厄立特亚国 |
| ESP | 西班牙 |
| ETH | 埃赛俄比业 |
| FIN | 芬兰 |
| FJI | 斐济 |
| FRA | 法国 |
| GBR | 英国 |
| GHA | 加纳共和国 |
| GIB | 直布罗陀 |
| GMB | 冈比亚 |
| GNB | 几内亚比绍 |
| GNQ | 赤道几内亚共和国 |
| GRC | 希腊 |
| GTM | 危地马拉 |
| GUM | 关岛 |
| GUY | 圭亚那 |
| HKG | 香港 |
| HND | 洪都拉斯 |
| HRV | 克罗地亚 |
| HTI | 海地共和国 |
| HUN | 匈牙利 |
| IDN | 印尼 |
| IND | 印度 |
| INU | 纽埃 |
| IRL | 爱尔兰 |
| IRN | 伊朗 |
| ISL | 冰岛 |
| ITA | 意大利 |
| JAM | 牙买加 |
| JOR | 约旦 |
| JPN | 日本 |
| KAZ | 哈萨克斯坦共和国 |
| KEN | 肯尼亚共和国 |
| KHM | 東埔寨 |
| KIR | 基里巴斯共和国 |
| KNA | 圣基茨和尼维斯联邦 |
| KOR | 韩国 |
| KWT | 科威特 |



| | · |
|-----|------------|
| 代码 | 国家和地区中文名称 |
| LAO | 老挝 |
| LBN | 黎巴嫩 |
| LBR | 利比里亚 |
| LIE | 列支敦士登 |
| LKA | 斯里兰卡 |
| LSO | 莱索托 |
| LTU | 立陶宛共和国 |
| LUX | 卢森堡 |
| MAC | 澳门 |
| MAR | 摩洛哥 |
| MDG | 马达加斯加 |
| MEX | 墨西哥 |
| MHL | 马绍尔群岛共和国 |
| MLI | 马里共和国 |
| MLT | 马耳他 |
| MMR | 缅甸 |
| MNG | 蒙古 |
| MOZ | 莫桑比克 |
| MUS | 毛里求斯 |
| MYS | 马来西亚 |
| NAM | 纳米比亚共和国 |
| NGA | 尼日利亚 |
| NIC | 尼加拉瓜 |
| NLD | 荷兰 |
| NOR | 挪威 |
| NPL | 尼泊尔 |
| NRU | 瑙鲁共和国 |
| NZL | 新西兰 |
| OWN | 阿曼 |
| PAK | 巴基斯坦 |
| PAN | 巴拿马 |
| PER | 秘鲁 |
| PHL | 菲律宾 |
| PNG | 巴布亚新几内亚独立国 |
| POL | 波兰 |
| PRI | 波多黎各 |
| PRK | 朝鲜 |
| PRT | 葡萄牙 |
| PRY | 巴拉圭 |
| QAT | 卡塔尔 |
| ROM | 罗马尼亚 |

| RUS 俄罗斯联邦 SAU 沙特阿拉伯 SDN 苏丹 SEN 塞内加尔 SCP 新加坡 SLB 所罗门群岛 SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VOB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | 代码 | 国家和地区中文名称 |
|---|-----|-----------|
| SDN 苏丹 SEN 塞内加尔 SGP 新加坡 SLB 所罗门群岛 SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | RUS | 俄罗斯联邦 |
| SEN 塞内加尔 SGP 新加坡 SLB 所罗门群岛 SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SAU | 沙特阿拉伯 |
| SGP 新加坡 SLB 所罗门群岛 SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SDN | 苏丹 |
| SLB 所罗门群岛 SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SEN | 塞内加尔 |
| SLE 塞拉利昂 SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛文尼亚 SWN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SGP | 新加坡 |
| SLV 萨尔瓦多 SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAR 扎伊尔 | SLB | 所罗门群岛 |
| SUR 苏里南共和国 SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VIR 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SLE | 塞拉利昂 |
| SVK 斯洛伐克 SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SLV | 萨尔瓦多 |
| SVN 斯洛文尼亚 SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SUR | 苏里南共和国 |
| SWE 瑞典 SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SVK | 斯洛伐克 |
| SYC 塞舌尔 SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SVN | 斯洛文尼亚 |
| SYR 叙利亚 TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SWE | 瑞典 |
| TGO 多哥 THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SYC | 塞舌尔 |
| THA 泰国 TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | SYR | 叙利亚 |
| TON 汤加 TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | TGO | 多哥 |
| TTO 特立尼达和多巴哥 TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | THA | 泰国 |
| TUR 土耳其 TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | TON | 汤加 |
| TUV 图瓦卢 UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | TTO | 特立尼达和多巴哥 |
| UGA 乌干达共和国 UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | TUR | 土耳其 |
| UKR 乌克兰 URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | TUV | 图瓦卢 |
| URY 乌拉圭 USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | UGA | 乌干达共和国 |
| USA 美国 VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | UKR | 乌克兰 |
| VEN 委内瑞拉 VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | URY | 乌拉圭 |
| VGB 英属维尔京群岛 VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | USA | 美国 |
| VIR 美属维尔京群岛 VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | VEN | 委内瑞拉 |
| VNM 越南 WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | VGB | 英属维尔京群岛 |
| WSM 西萨摩亚 YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | VIR | 美属维尔京群岛 |
| YEM 也门 YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | VNM | 越南 |
| YUG 南斯拉夫 ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | WSM | 西萨摩亚 |
| ZAF 南非 ZAR 扎伊尔 | YEM | 也门 |
| ZAR 扎伊尔 | YUG | 南斯拉夫 |
| | ZAF | 南非 |
| | ZAR | 扎伊尔 |
| ZMB 赞比亚 | ZMB | 赞比亚 |
| ZWE 津巴布韦 | ZWE | 津巴布韦 |



六、 结算参与人文件传送接口规范

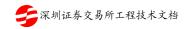
本规范描述结算参与人与中国结算通过 D-COM 系统(含 IST 终端)完成的,以文件上传方式进行数据交换的接口库,包括结算参与人申请库(SJSSQ.dbf)和结算参与人数据确认库(SJSQR.dbf)。

结算参与人生成申请库(SJSSQ.dbf)后,以文件方式上传至结算公司,结算公司定时接收并检查参与人上传的申请库,检查结果通过确认库(SJSQR.dbf)反馈给参与人。该确认库仅作为结算公司对结算参与人申请数据的接收确认,只对申请数据进行合法性检查,最终的业务处理结果将通过股份结算接口规范及资金结算接口规范中的相关接口库返回给各券商营业部。

在结算公司规定的数据接收截止时间前,如果参与人多次发送申请数据,结算公司以最后一次发送的数据为准。

21. 结算参与人申请库 SJSSQ.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 是否必须 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|------|-----------|
| 1 | SQYWLB | 业务类别 | С | 2 | 必须 | |
| 2 | SQZQDM | 证券代码 | C | 6 | 必须 | |
| 3 | SQGDDM | 证券账户 | С | 10 | 必须 | |
| 4 | SQXWDM | 席位代码 | С | 6 | 必须 | |
| 5 | SQGFXZ | 股份性质 | C | 2 | | |
| 6 | SQZJJS | 资金结算主席 | C | 6 | 必须 | |
| | | 位 | | | | |
| 7 | SQYWSJ | 业务数据 | С | 30 | | |
| 8 | SQBZ1 | 标志 1 | C | 1 | | |
| 9 | SQBZ2 | 标志 2 | С | 1 | | |
| 10 | SQWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | | |
| 11 | SQWTZJ | 委托资金 | N | 16,3 | | |
| 12 | SQWTJG | 委托价格 | N | 9,3 | | |
| 13 | SQWTXH | 委托序号 | C | 8 | 必须 | 同一席位下不能重复 |
| 14 | SQSFZL | 收付种类 | C | 1 | | 双向报盘的业务需要 |
| | | | | | | 填写 |
| 15 | SQDFXW | 对方席位 | C | 6 | | 双向报盘的业务必须 |
| | | | | | | 填写 |
| 16 | SQDFGD | 对方证券账户 | C | 10 | | 部分双向报盘的业务 |
| | | | | | | 需要填写 |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 是否必须 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|------|------------|
| 17 | SQDFXZ | 对方股份性质 | С | 2 | | |
| 18 | SQBZNR | 备注内容 | С | 60 | | |
| 19 | SQRQ1 | 日期1 | N | 8,0 | | |
| 20 | SQRQ2 | 日期2 | N | 8,0 | | |
| 21 | SQWTRQ | 委托日期 | D | | 必须 | |
| 22 | SQCLXH | 处理序号 | N | 10,0 | 必须 | 大于零的整数。同一资 |
| | | | | | | 金结算主席位下不能 |
| | | | | | | 重复,结算公司据此顺 |
| | | | | | | 序进行业务处理 |
| 23 | SQTXBZ | 通信标志 | С | 1 | | |
| 24 | SQQSBZ | 券商标志 | C | 1 | | |
| 25 | SQBYZD | 备用字段 | С | 6 | | 保留 |

(1) **SQYWLB**(字段 1: 业务类别),含义详见委托业务类别含义表,表十五。 "双向报盘"指业务所涉及的双方都需要报盘;"备注"栏说明了报盘时需要申报的 对手方信息及其它注意事项。

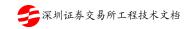
| 委托业 | 久米 | 别会》 | 去 (| 去十 | - 五) | ١ |
|-----|----|------|-------|----------|--------------|---|
| | 分ケ | カルろろ | -XX (| \sim 1 | <i>1</i> L) | 1 |

| SQYWLB | 业务含义 | 是否双向报盘 | 备注 |
|--------|----------|--------|----|
| 7A | 冻结报盘 | 否 | |
| 7B | 冻结解冻报盘 | 否 | |
| 7C | 冻结续冻报盘 | 否 | |
| 7D | 轮候冻结报盘 | 否 | |
| 7E | 轮候冻结解除报盘 | 否 | |

- (2) **SQGDDM**, **SQDFGD** (字段 3,15: 证券账户), 为十位数字字符, 不足十位的左端补足'0', 不可含空格。
- (3) **SQGFXZ,SQDFXZ**(字段 5,16: 股份性质),具体定义见股份性质定义表,表十六。暂时只允许申报流通股的业务,结算公司忽略该字段的内容,一律按照流通股(股份性质为 00)处理。

股份性质定义表 (表十六)

| 股份性质 | 代号 | |
|-------|-----------|----|
| 公众已托管 | 社会公众股 | 00 |
| | 基金配售股份 | 01 |
| | 战略投资者配售股份 | 02 |
| | 一般法人配售股份 | 03 |
| | 高管买入股份 | 04 |
| | 限售流通股(个人) | 05 |



| 股份性质 | 代号 | |
|-------|-----------|----|
| | 限售流通股(机构) | 06 |
| 发起人股 | 国家股 | 10 |
| | 国有法人股 | 11 |
| | 境内法人股 | 12 |
| | 外资法人股 | 13 |
| | 自然人 | 14 |
| | 其他 | 15 |
| 定向法人股 | 国家股 | 20 |
| | 国有法人股 | 21 |
| | 境内法人股 | 22 |
| | 外资法人股 | 23 |
| | 自然人 | 24 |
| | 其他 | 25 |
| 内部职工股 | | 30 |
| 高管股 | | 40 |
| 公众未托管 | | 50 |

- (4) **SQZJJS**(字段 6: 资金结算主席位),席位代码(SQXWDM)所属的资金结算主席位,用于上传数据的安全性检查,限制用户只能发送属于自己资金结算主席位下的数据。
- (5) **SQYWSJ**(字段 7: 业务数据),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表十七。

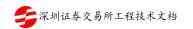
业务数据字段用法一览表(表十七)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|-------|-------|----------------|
| 7B、7C | 原冻结序号 | 10 位字符,左对齐右补空格 |
| 7E | 原轮候序号 | 10 位字符,左对齐右补空格 |
| 其它 | 待用 | 空 |

(6) **SQBZ1**(字段 8: 标志 1),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表十八。

标志1字段用法一览表(表十八)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|-------|------|---|
| 7A、7D | 联冻深度 | 原股冻结 原股+红股冻结 原股+红股+配股(权证及认购后股份)冻结 |
| 其它 | 待用 | 空 |



(7) **SQBZ2**(字段 9: 标志 2),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表十九。

标志 2 字段用法一览表 (表十九)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|-------|--------|--------------------|
| 7A、7D | 执行机关类型 | A: 法院 B: 证监会 C: 其他 |
| 其它 | 待用 | 空 |

(8) **SQWTSL**(字段 10: 委托数量)用于申报证券数量。不同业务类别对应不同用法,具体内容见表二十。

委托数量字段用法一览表 (表二十)

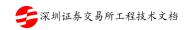
| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|------|----------|--------------------|
| 7A | 申请冻结股数 | >0, 冻结指定股数; |
| | | 填 0,则冻结所有股数; |
| 7B | 申请解冻股数 | >0,解冻指定股数; |
| | | 填 0,则解冻所有股数; |
| 7D | 申请轮候冻结股数 | >0,轮候冻结指定股数; |
| | | 填 0,则轮候冻结所有已冻结的股数; |
| 其它 | 待用 | 0 |

- (9) SQWTZJ(字段11: 委托资金)用于申报资金金额。
- (10) SOWTJG(字段12: 委托价格)用于申报证券价格。
- (11) SQWTXH(字段13:委托序号), 唯一标识同一席位的委托, 不能重复。 委托序号只可以由英文字母或阿拉伯数字组成, 由券商根据实际需要确定生成方 式。
- (12) SQSFZL (字段 14: 收付种类),双向报盘业务使用,'F'表示本方为付方;'S'表示本方为收方;非双向报盘业务填空格。
- (13) SQBZNR (字段 18: 备注内容),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表二十一。

备注内容字段用法一览表 (表二十一)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|-------|----------|---------|
| 7A、7D | 冻结执行机关名称 | 左对齐右补空格 |
| 其它 | 待用 | 空 |

(14) **SQRQ1** (字段 19: 日期 1),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表二十二。



日期1字段用法一览表(表二十二)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|------|--------|-------------------------------|
| 7A | 冻结起始日期 | 不为 0,格式为 YYYYMMDD,用于历史冻结数据申报; |
| | | 为 0, 冻结起始日期为当日; |
| 其它 | 待用 | 0 |

(15) **SQRQ2** (字段 20: 日期 2),不同业务类别对应不同用法,具体内容见表二十三。

日期2字段用法一览表(表二十三)

| 业务类别 | 字段含义 | 备注 |
|------|--------|--|
| 7A | 冻结截止日期 | 不为 0,格式为 YYYYMMDD,表示冻结截止日期; 0,表示无限期冻结; |
| 7C | 续冻截止日期 | 不为 0,格式为 YYYYMMDD,表示续冻的冻结截止日期; 0,表示续冻为无限期冻结; |
| 7D | 轮候冻结期限 | >0,单位为月。最大轮候冻结期限为99个月。 |
| 其它 | 待用 | 0 |

- (16) SQWTRQ (字段 21: 委托日期),委托写入的日期。
- (17) SQCLXH(字段 22: 处理序号),结算参与人在同一资金结算主席位下指定的处理顺序编号。必须为大于零的整数。同一资金结算主席位下不能重复,结算公司据此顺序进行业务处理。
 - (18) SQTXBZ (字段 23: 通信标志), 供通信公司使用。
 - (19) SQQSBZ (字段 24: 券商标志), 供券商自用。

22. 结算参与人确认库 SJSQR.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|---------|----|------|-------|
| 1 | QRLSHM | 流水号码 | С | 10 | 数字字符串 |
| 2 | QRYWLB | 业务类别 | С | 2 | |
| 3 | QRZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 4 | QRGDDM | 证券账户 | С | 10 | |
| 5 | QRXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 6 | QRGFXZ | 股份性质 | С | 2 | |
| 7 | QRZJJS | 资金结算主席位 | С | 6 | |
| 8 | QRYWSJ | 业务数据 | С | 30 | |
| 9 | QRBZ1 | 标志 1 | С | 1 | |
| 10 | QRBZ2 | 标志 2 | С | 1 | |
| 11 | QRWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | |
| 12 | QRWTZJ | 委托资金 | N | 16,3 | |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|----|
| 13 | QRWTJG | 委托价格 | N | 9,3 | |
| 14 | QRWTXH | 委托序号 | С | 8 | |
| 15 | QRSFZL | 收付种类 | С | 1 | |
| 16 | QRDFXW | 对方席位 | С | 6 | |
| 17 | QRDFGD | 对方证券账户 | С | 10 | |
| 18 | QRDFXZ | 对方股份性质 | С | 2 | |
| 19 | QRBZNR | 备注内容 | С | 60 | |
| 20 | QRRQ1 | 日期1 | N | 8,0 | |
| 21 | QRRQ2 | 日期2 | N | 8,0 | |
| 22 | QRWTRQ | 委托日期 | D | | |
| 23 | QRCLXH | 处理序号 | N | 10,0 | |
| 24 | QRCWDH | 错误代号 | С | 3 | |
| 25 | QRQSBZ | 券商标志 | С | 1 | |
| 26 | QRBYZD | 备用字段 | С | 6 | 保留 |

- (1) QRLSHM(字段 1: 流水号码),是结算公司主机当日产生的流水号码,以表示该笔委托已经被结算公司主机接收。
- (2) QRCWDH(字段 24: 错误代号), 为结算公司主机对该笔委托进行数据合法性检查的结果, 错误代码的详细含义参见表六。
 - (3) QRQSBZ(字段 25: 券商标志), 供券商自用。
- (4) 其他字段均参考结算参与人申请库的字段说明,且字段内容与参与人所委托的内容相同。

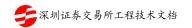


七、 结算参与人实时传送接口规范

本部分规范描述了结算参与人与中国结算通过 D-COM 系统(含 IST 终端) 完成的,以实时传送方式进行数据交换的接口库,包括非交易报送库(FJYBS.dbf) 和非交易确认库(FJYQR.dbf)两个数据库。结算公司实时接收并检查处理参与人申报的非交易报送库,检查结果通过非交易确认库实时反馈给参与人。该确认库仅作为结算公司对结算参与人委托数据的接收确认,只对申请数据进行合法性检查,最终的业务处理结果将通过股份结算接口规范及资金结算接口规范中的相关接口库返回给各券商营业部。

23.非交易报送库 FJYBS.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|---------|----|------|--------------|
| 1 | BSZJJS | 资金结算主席位 | С | 6 | 必填项 |
| 2 | BSYWLB | 业务类别 | С | 2 | 必填项 |
| 3 | BSWTLX | 委托类型 | C | 1 | 必填项 |
| | | | | | S=申报,C=撤单 |
| 4 | BSWTXH | 委托序号 | С | 8 | 必填项,委托流水号 |
| 5 | BSZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 6 | BSGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 7 | BSXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 8 | BSYWSJ | 业务数据 | С | 30 | 保留 |
| 9 | BSGFXZ | 股份性质 | C | 2 | 保留 |
| 10 | BSWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | |
| 11 | BSWTZJ | 委托资金 | N | 16,3 | |
| 12 | BSWTJG | 委托价格 | N | 9,3 | |
| 13 | BSBZ1 | 标志1 | С | 1 | 保留 |
| 14 | BSBZ2 | 标志 2 | С | 1 | 保留 |
| 15 | BSDFXW | 对方席位 | С | 6 | |
| 16 | BSDFGD | 对方证券账户 | С | 10 | |
| 17 | BSDFXZ | 对方股份性质 | С | 2 | 保留 |
| 18 | BSNR1 | 备注内容1 | С | 60 | 保留 |
| 19 | BSNR2 | 备注内容2 | С | 120 | 保留 |
| 20 | BSRQ1 | 日期1 | N | 8,0 | 保留 |
| 21 | BSRQ2 | 日期2 | N | 8,0 | 保留 |
| 22 | BSWTRQ | 委托日期 | D | | 必填项 |
| 23 | BSWTSJ | 委托写入时间 | С | 8 | 必填项,HHMMSSXX |



| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|------|----|----|--------|
| 24 | BSCLBZ | 处理标志 | C | 1 | 必填项 |
| 25 | BSBYZD | 备用标志 | C | 1 | 券商系统自用 |

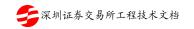
- (1) 必填项为所有委托必须填写的字段,非必填项字段将根据不同业务有不同定义,具体说明请详见业务类别填报字段说明表,表二十四。
- (2) BSZJJS(字段1: 资金结算主席位),席位代码(字段7: BSXWDM)所属的资金结算主席位,用于委托数据的安全性检查,限制用户只能发送属于自己资金结算主席位下的数据。
- (3) BSYWLB(字段 2: 业务类别),委托业务类别含义详见表二十五。不同业务的申报和撤单需要填报的非必填字段内容详见表二十四。
- (4) BSWTLX(字段 3: 委托类型), 'S'表示该笔委托为申报委托, 'C'表示该 笔委托为撤单委托。
- (5) BSWTXH(字段 4: 委托序号),即委托流水号码。该序号在相同业务类别中,唯一标识同一席位代码下的委托。委托序号只可以由英文字母或阿拉伯数字组成,由券商根据实际需要确定生成方式。
- (6) BSGDDM, BSDFGD (字段 6,16: 证券账户), 为十位数字字符, 不足十位的左端补足'0', 不可含空格。
 - (7) BSYWSJ(字段8: 业务数据),不同业务类别对应不同用法。
 - (8) BSGFXZ,BSDFXZ (字段 9,17: 股份性质), 结算公司保留字段。
- (9) BSBZ1(字段 13: 标志 1),不同业务类别对应不同用法。目前结算公司暂时未启用。
- (10) BSBZ2(字段14: 标志2),不同业务类别对应不同用法。目前结算公司暂时未启用。
- (11) BSNR1、BSNR2(字段18、字段19: 备注内容1、备注内容2),不同业务类别对应不同用法。目前结算公司暂时未启用。
- (12) BSRQ1、BSRQ2(字段20、字段21: 日期1、日期2),不同业务类别对应不同用法。目前结算公司暂时未启用。
 - (13) BSWTRO (字段 22: 委托日期), 券商委托申报的日期;
- (14) BSWTSJ(字段 23: 委托时间),券商委托写入的时间,HH表示小时,MM表示分钟,SS表示秒钟,XX备用,一般写 00。



- (15) BSCLBZ (字段 24: 处理标志), 表明本记录的处理状态。对于新的委 托记录, 其初始值由用户统一设置为'z'; 通信程序会对上行数据进行逐条检查, 将发送成功的记录设置为'1',将不成功的记录根据错误类型设置不同的错误代 码, 具体错误代码含义见表二十六。
 - (16) **BSBYDZ** (字段 25: 备用标志), 供券商系统自用。

业务类别填报字段说明表 (表二十四)

| BSYWLB | BSWTLX | 非必填项字段的填报说明 |
|--------|--------|---|
| R1 | S/申报 | BSZQDM,BSGDDM,BSXWDM,BSWTSL,BSDFXW,BSDFGD。 |
| | | 从投资者普通证券账户向客户信用交易担保专用证券账户提交担保 |
| | | 时,投资者在普通证券账户托管席位进行申报,BSGDDM 为其普通 |
| | | 证券账户,BSDFGD 为其信用证券账户,BSDFXW 为信用交易专用 |
| | | 席位。 |
| | | 从客户信用交易担保专用证券账户向投资者普通证券账户收回担保 |
| | | 时,投资者在信用交易专用席位进行申报,BSGDDM 为其信用证券 |
| | | 账户,BSDFGD 为其普通证券账户,BSDFXW 为其普通证券账户托 |
| | | 管席位。 |
| | C/撤单 | 无。 |
| | | BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。 |
| R2 | S/申报 | BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSDFXW, BSDFGD. |
| | | 证券公司向其融券专用证券账户划入时,在其自营证券账户的托管席 |
| | | 位进行申报, BSGDDM 为其自营证券账户, BSDFGD 为其融券专用 |
| | | 证券账户, BSDFXW 为其信用交易专用席位。 |
| | | 证券公司由其融券专用证券账户划出时,在其所在的信用交易专用席 |
| | | 位进行申报, BSGDDM 为其融券专用证券账户, BSDFGD 为其自营 |
| | | 证券账户, BSDFXW 为其自营证券账户托管席位。 |
| | C/撤单 | 无。 |
| | | BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。 |
| R3 | S/申报 | BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSDFGD. |
| | | 投资者向证券公司还券时,由投资者在其信用交易专用席位申报, |
| | | BSGDDM 为投资者的信用证券账户,BSDFGD 为证券公司融券专用 |
| | | 证券账户。 |
| | | 证券公司向投资者退券时,由证券公司在其信用交易专用席位申报, |
| | | BSGDDM 为证券公司融券专用证券账户,BSDFGD 为投资者的信用 |
| | | 证券账户。 |
| | C/撤单 | 无。 |
| | | BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。 |
| X2 | S/申报 | BSGDDM, BSXWDM, BSDFGD |
| | | BSGDDM 为上海挂账账户, BSXWDM 为股份补登记后深圳托管席 |
| | | 位,BSDFGD 为补登记后深圳账户。 |



| BSYWLB | BSWTLX | 非必填项字段的填报说明 |
|--------|--------|------------------------|
| | C/撤单 | 无。 |
| | | BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。 |

委托业务类别含义表 (表二十五)

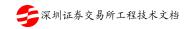
| BSYWLB | 委托业务含义 | 报盘方式 |
|--------|---|---------------------|
| R1 | 担保证券提交与返还 (投资者普通证券账户与证券公司客户信用交易担保专 用证券账户之间的非交易过户业务) | 单边报盘,由划出方进 行单边报盘 |
| R2 | 融券券源划拨 (证券公司自营证券账户与证券公司融券专用证券账户 之间的非交易过户业务) | 单边报盘,由划出方进 行单边报盘 |
| R3 | 现券还券划拨 (证券公司客户信用交易担保专用证券账户与证券公司 融券专用证券账户之间的非交易过户业务) | 单边报盘,由划出方进 行单边报盘 |
| X2 | 沪市账户挂账股份补登记 | 单边报盘 |

处理标志错误含义表 (表二十六)

| 错误代码 | 错误描述 |
|------|-------------------|
| A | 资金结算主席位错误 |
| В | 委托类型错误 |
| C | 委托序号格式错误 |
| D | 委托数量格式错误 |
| Е | 委托资金格式错误 |
| F | 委托价格格式错误 |
| G | 日期1格式错误 |
| Н | 日期2格式错误 |
| I | 委托日期格式错误或者不为当天 |
| J | BSCLBZ 没有填'z' |
| K | 该委托记录标有 DELETE 标记 |
| L | 超出规定的委托受理时间 |
| M | 业务类别错误 |
| N | 委托时间错误 |

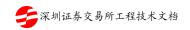
24.非交易确认库 FJYQR.dbf

| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|---------|----|----|-------|
| 1 | QRLSHM | 流水号码 | С | 10 | 数字字符串 |
| 2 | QRZJJS | 资金结算主席位 | С | 6 | |



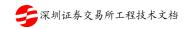
| 序号 | 字段名 | 字段描述 | 类型 | 长度 | 备注 |
|----|--------|--------|----|------|-----------|
| 3 | QRYWLB | 业务类别 | С | 2 | |
| 4 | QRWTLX | 委托类型 | С | 1 | S=申报,C=撤单 |
| 5 | QRWTXH | 委托序号 | С | 8 | 委托流水号 |
| 6 | QRZQDM | 证券代码 | С | 6 | |
| 7 | QRGDDM | 证券账户 | C | 10 | |
| 8 | QRXWDM | 席位代码 | С | 6 | |
| 9 | QRYWSJ | 业务数据 | C | 30 | |
| 10 | QRGFXZ | 股份性质 | C | 2 | |
| 11 | QRWTSL | 委托数量 | N | 12,0 | |
| 12 | QRWTZJ | 委托资金 | N | 16,3 | |
| 13 | QRWTJG | 委托价格 | N | 9,3 | |
| 14 | QRBZ1 | 标志 1 | C | 1 | |
| 15 | QRBZ2 | 标志 2 | С | 1 | |
| 16 | QRDFXW | 对方席位 | С | 6 | |
| 17 | QRDFGD | 对方证券账户 | C | 10 | |
| 18 | QRDFXZ | 对方股份性质 | C | 2 | |
| 19 | QRNR1 | 备注内容1 | C | 60 | |
| 20 | QRNR2 | 备注内容 2 | C | 120 | |
| 21 | QRRQ1 | 日期1 | N | 8,0 | |
| 22 | QRRQ2 | 日期2 | N | 8,0 | |
| 23 | QRWTRQ | 委托日期 | D | | |
| 24 | QRWTSJ | 委托写入时间 | С | 8 | HHMMSSXX |
| 25 | QRCWDH | 错误代号 | С | 3 | 空表示申报成功, |
| | | | | | 否则返回错误代码 |
| 26 | QRQSBZ | 备用标志 | С | 1 | 券商系统自用 |

- (1) **QRLSHM**(字段 1: 流水号码),是结算公司主机当日产生的流水号码,以表示该笔委托已经被结算公司主机接收。
- (2) **QRCWDH**(字段 25: 错误代号),为本公司主机对委托自动撤单的原因返回的代码,详见表六。
- (3) 其他字段均参考非交易报送库的字段说明,且结算公司回报的内容与参与人所委托的内容完全相同。



错误代码含义表(表六)

| 错误代码 | 错误代码含义 |
|------|-----------------------|
| 空格 | 正常 |
| B01 | 证券账户无效 |
| B02 | 正式交收时股份被冻结 |
| В03 | 指令未配对 |
| D01 | 证券代码无效 |
| D05 | 转入席位无效 |
| D06 | 此证券不可转托管 |
| D07 | 转出席位不允许转托管 |
| D08 | 转入席位不允许转托管 |
| D09 | 委托的转托管股数小于等于 0 |
| D10 | 可转托管股数小于委托股数 |
| D11 | 该股东无托管股份 |
| D12 | 该证券有部分冻结,不可全部转托管 |
| D13 | 该代销机构不能代理该基金 |
| D14 | 尚未注册对应开放式基金账户 |
| D15 | 对应开放式基金账户尚未在转入方办理注册确认 |
| D30 | 此证券不可质押 |
| D31 | 此股东不可质押 |
| D32 | 此席位不可质押 |
| D33 | 席位代码无效 |
| D33 | 席位代码无效 |
| D34 | 委托股数小于等于零 |
| D35 | 可质押/解押股数小于委托股数 |
| D36 | 质押股数超出限制比例 |
| D37 | 质押日期无效 |
| D38 | 质押双方报盘记录不匹配 |
| D39 | 被司法冻结,不可解押解冻 |
| D43 | 收购人编码无效 |
| D44 | 可用股数不足 |
| D45 | 委托日期不在要约有效期内 |
| D45 | 行权委托日期不在有效日期内 |
| D54 | 该证券不可行权 |
| D55 | 履约证券不足 |
| D56 | 交收权证不足 |
| D57 | 交收资金不足 |
| D60 | 委托股数无效 |
| D61 | 冻结起止日/续冻到期日/轮候冻结期限无效 |



| 错误代码 | 错误代码含义 |
|------|----------------|
| D62 | 执法机关类型无效 |
| D63 | 执法机关名称为空 |
| D64 | 联冻深度无效 |
| D65 | 冻结序号无效 |
| D66 | 轮候序号无效 |
| D67 | 业务类别无效 |
| E01 | 证券帐户无效 |
| E02 | 重复申购 |
| E03 | 申购股数无效 |
| E04 | 无市值 |
| E05 | 席位代码无效 |
| E07 | 竞价申购失败 |
| E08 | 申购资金不足 |
| E09 | 认购不确认 |
| E50 | 业务类别无效 |
| E51 | 席位代码无效 |
| E52 | 证券代码无效 |
| E53 | 证券账户无效 |
| E54 | 股份性质无效 |
| E55 | 收付种类无效 |
| E56 | 委托序号无效 |
| E57 | 委托日期无效 |
| E58 | 席位不从属于资金结算主席位 |
| E59 | 席位被禁买或禁卖 |
| E60 | 证券账户被禁买或禁卖 |
| E61 | 对方席位代码无效 |
| E62 | 对方证券代码无效 |
| E63 | 对方证券账户无效 |
| E64 | 对方股份性质无效 |
| E65 | 对方席位被禁买或禁卖 |
| E66 | 对方证券账户被禁买或禁卖 |
| E67 | 处理序号无效 |
| K32 | 两帐户身份证/注册号码不一致 |
| K35 | 序号重复,委托无效 |
| K41 | 有司法冻结股份 |