



深圳证券交易所工程技术文档

深圳证券交易所跨市场 ETF 业务 券商技术系统变更指南

(Ver 1.0)



电脑工程部

二 九年十一月

关于本文档

文档名称	深圳证券交易所跨市场ETF业务券商技术系统变更指南		
说明	为券商等相关单位进行跨市场ETF业务相关技术准备工作的指南		
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2009-11-26	Ver0.9	创建	征求意见稿
2009-12-1	Ver1.0	修订	正式发布稿

目 录

一、	说明.....	1
二、	跨市场 ETF 业务简介	2
2.1	恒指 ETF 简介	2
2.2	跨市场 ETF 业务介绍	2
三、	跨市场 ETF 和本市场 ETF 的不同点	5
四、	跨市场 ETF 的主要技术变更	7
4.1	申购赎回清单	7
4.2	深交所数据接口规范的调整	10
4.3	基金管理人接口规范的调整	12
五、	券商系统支持跨市场 ETF 业务的注意事项	12
六、	附件一：恒指 ETF 申购赎回清单	12
七、	附件二：SJSGE.DBF 中 ‘ L9 ’ 业务详细描述	16

深圳证券交易所

跨市场 ETF 业务券商技术系统变更指南

一、说明

为便于参与深圳证券交易所（以下简称深交所）跨市场 ETF 的会员公司和相应 IT 提供商更好地理解跨市场 ETF 业务和了解相关技术系统，尽快做好会员公司端技术系统的准备工作，本所编制和发布本指南文档。

本文档中的跨市场 ETF 泛指包含有非深圳市场（以下简称“深市”）成份股的 ETF，但目前本文档只着重于港股 ETF。未来如有其他类型的跨市场 ETF，本所将根据需要及时修改并发布本文档。

编制本文档的依据：华夏基金管理有限公司（以下简称华夏基金公司）恒生指数 ETF 产品方案；本所当前正使用的技术系统接口；本所已发布的针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》。

本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，要减少系统改造对会员公司带来的影响。

本文中未涉及的内容请参考深交所及中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称中国结算深圳分公司）公布的业务实施细则及现有业务规则。

技术咨询电话：(0755) 25918199

(0755) 25918503

(0755) 25946080（中国结算深圳分公司）

业务咨询电话：(0755) 25918540

特别提示：本文档主要介绍跨市场 ETF 和现有本市场 ETF 业务的不同，以及由此导致的技术变更，相同的部分请各会员单位参考针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》。

该指南包括深交所和中国结算深圳分公司提供的业务服务，供有关单位参考。如果业务规则及业务方案有所变更，本文档也可能会有所变更。

请各会员单位根据自身需要，参照本指南的相应内容，做好相关的技术准备工作。

二、跨市场 ETF 业务简介

2.1 恒指 ETF 简介

恒指 ETF 属于港股 ETF，紧密跟踪标的指数（香港恒生指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，其业绩比较基准为香港恒生指数。

恒指 ETF 主要投资于跟踪标的指数的成份股、备选成份股及替代性股票。为更好地实现投资目标，还可投资于香港证券市场的债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

恒指 ETF 主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2.2 跨市场 ETF 业务介绍

下面以恒指 ETF 为例简要介绍跨市场 ETF 业务模式，主要包括基金的发行认购，上市交易，申购赎回，基金份额参考净值（IOPV）揭示。

2.2.1 证券编码

跨市场 ETF 使用 1599xx 证券代码区间，和本市场 ETF 统一顺序编码。

2.2.2 基金募集

同本市场 ETF，跨市场 ETF 的募集采用现金方式。现金认购主要面向交易所场内投资者。现金认购以人民币办理，认购面值为每基金份额 1 元人民币，通过我所场内网上发售系统进行。

2.2.3 基金上市交易

可以在我所集中竞价交易平台和协议交易平台交易，交易规则和本市场 ETF 相同。

2.2.4 基金申购赎回

跨市场 ETF 在申购赎回时对非深市成份股采用现金替代，投资者付出（申购时）和获得（赎回时）现金，由基金公司代理买卖非深市成份股。

由于所在市场不同，下文中资金交收周期（T+n）也不一定相同。下文只是以恒指 ETF 为例说明跨市场 ETF 的申购赎回流程。

● 申购业务流程

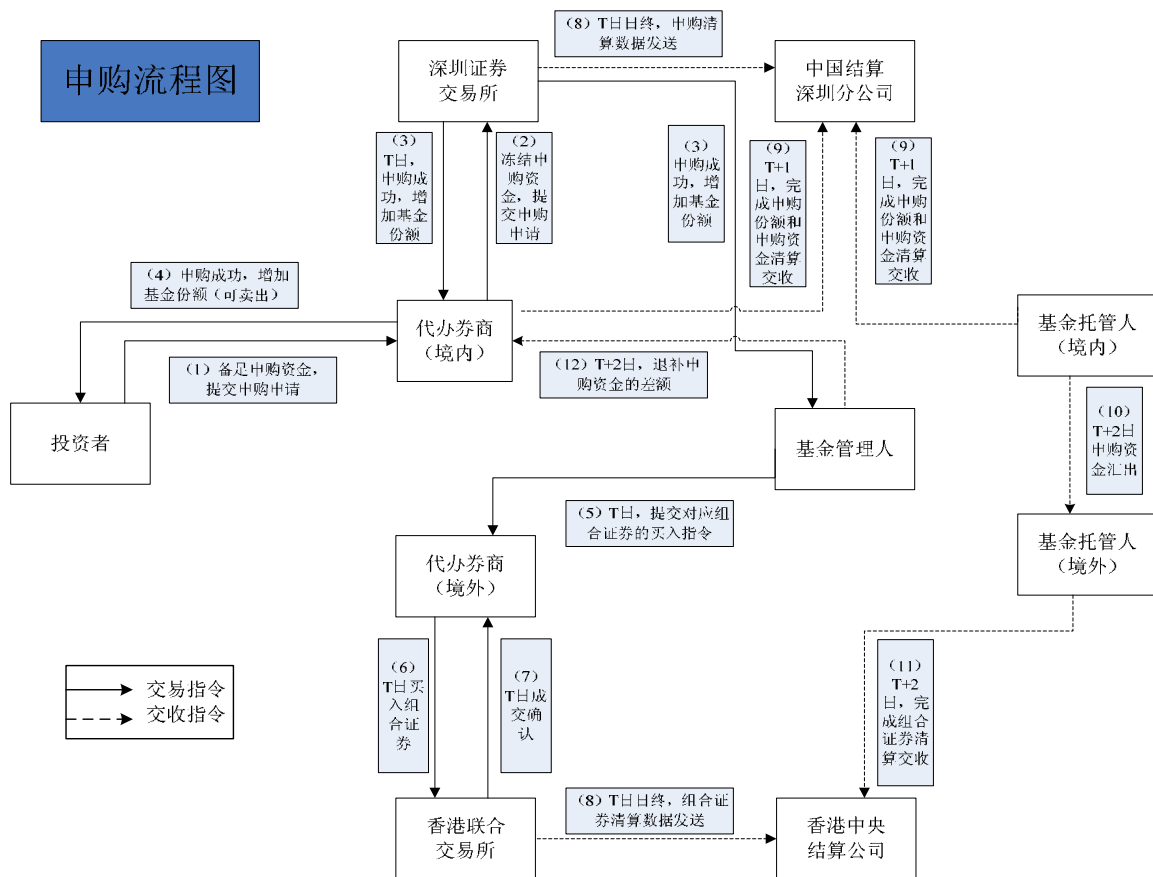


图 1 港股 ETF 申购流程图

(1) T 日交易时间：投资者通过代办券商(境内)向深交所提出申购申请，代办券商(境内)冻结相应的现金

(2) T 日交易时间：深交所实时对申购进行确认，增加投资者的基金份额

(3) T 日交易时间：基金管理人根据深交所实时发送的申购确认数据，向代办券商(境外)发出买入组合证券的指令

(4) T 日交易时间：代办券商(境外)及时完成买入组合证券的指令

(5) T 日日终：中国结算深圳分公司进行申购资金及份额的清算

(6) T+1 日：中国结算深圳分公司进行申购资金及份额的交收（均为担保交收），并将申购资金划给基金

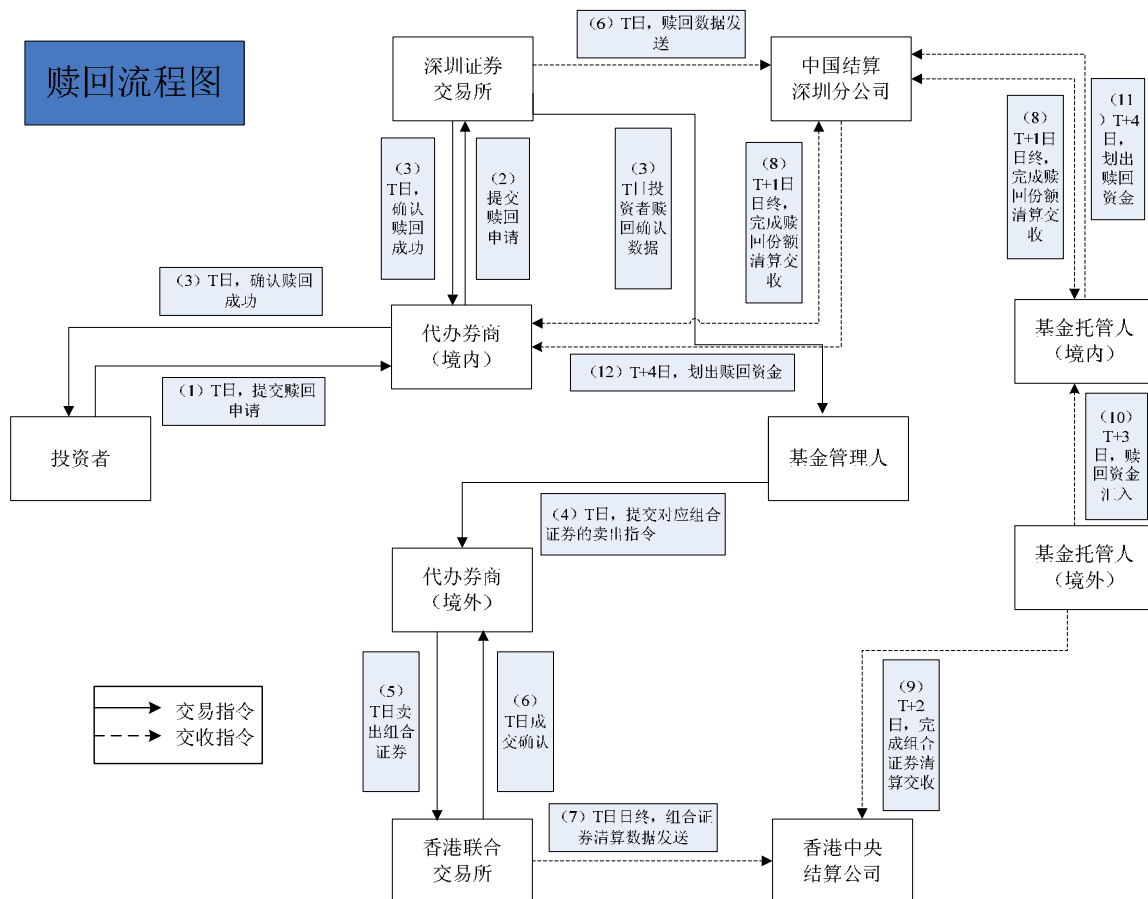
(7) T+1 日，基金管理人向中国结算深圳分公司发送现金差额指令，中国结算深圳分公司进行清算处理，纳入 T+2 日净额交收

(8) T+2 日：申购资金到账后，基金管理人通过托管人(境内)完成换汇，并

汇到在托管人(境外)开立的港币账户，通过托管人(境外)完成组合证券及对应资金的清算交收

(9) T+N 日 (N 由基金公司决定)：基金管理人将申购现金替代的多退少补数据发给中国结算深圳分公司，中国结算深圳分公司 T+N+1 进行资金的代收代付

● 赎回业务流程



- (1) T 日交易时间：投资者通过代办券商(境内)向深交所提出赎回申请
- (2) T 日交易时间：深交所实时对赎回进行确认，扣减投资者的基金份额
- (3) T 日交易时间：基金管理人根据深交所实时发送的赎回确认数据，向代办券商(境外)发出卖出组合证券的指令
- (4) T 日交易时间：代办券商(境外)及时完成卖出组合证券的指令
- (5) T+1 日：中国结算深圳分公司进行赎回份额的担保交收

(6) T+1 日, 若基金管理人向中国结算深圳分公司发送现金差额指令, 中国结算深圳分公司将进行清算处理, 纳入 T+2 日净额交收

(7) T+2 日: 托管人(境外)完成组合证券及对应资金的清算交收

(8) T+3 日: 组合证券卖出资金到账后, 汇到在托管人(境内)开立的港币账户, 通过托管人(境内)完成结汇

(9) T+N 日 (N 由基金公司决定, 和申购流程中的 N 可以相同, 也可不同): 基金管理人将赎回现金数据发给中国结算深圳分公司, 中国结算深圳分公司 T+N+1 进行资金的代收代付

2.2.5 基金份额参考净值 (IOPV) 揭示

和本市场 ETF 相同, 深交所通过 SJSHQ.DBF 中的 HQSYL2(市盈率 2)发布 IOPV (每百份基金单位净值估值), 即 HQSYL2/100 的值为每份基金 IOPV 值, 发布频率为每 5 秒一次。

三、跨市场 ETF 和本市场 ETF 的不同点

从上面的描述可以看出, 跨市场 ETF 和本市场 ETF 的大部分业务模式相同, 主要的区别在于申购赎回处理的某些环节。

为便于在申购赎回时对跨市场 ETF 中的一揽子非深市成份股进行现金替代, 深交所新增虚拟成份股 159900 用于整体现金替代。对该虚拟成份股进行现金替代即相当于对一揽子非深市成份股进行现金替代。为配合结算模式改造, 我所在进行赎回的现金替代回报时, 会将替代金额设置为 0。为控制风险, 我所根据基金公司需求对当日申购、赎回规模进行控制。若当日申购或者赎回总量超过限制, 当日不再允许进行申购赎回。

因为赎回时涉及境内外资金的划转, 并且境外交易所的交收周期和国内交易所未必一致, 为了控制结算风险, 中国结算深圳分公司对赎回资金实行非担保交收。基金公司负责对赎回资金进行清算, T+N 日 (T 为赎回委托日, N 由基金公司决定) 中国结算深圳分公司接到基金公司指令后, 转发明细赎回资金指令给券商 (通过 SJSGF.DBF 接口), 同时体现在当日的资金清算数据 (SJSQS.DBF) 中, 次结算日 (T+N+1 日) 完成资金的代收代付, 若应付方资金不足, 则代收代付失败。

这些失败的指令，基金公司可以以后再次发给中国结算深圳分公司进行代收代付，中国结算深圳分公司再次转发明细赎回资金指令给券商。具体可参见相关业务文档。

表 1 跨市场 ETF 与本市场 ETF 的主要不同

项目名	跨市场 ETF	现有本市场 ETF
成份股构成	1. 包含非深市成份股，也可能包含深市成份股（如恒指 ETF 或者沪深 300ETF）	1. 都是深市成份股
申购赎回申报	2.1 开放日为两个市场的共同交易日； 2.2 对非深市成份进行现金替代，对深市成份股和 ETF 份额的股份监控规则不变； 2.3 使用 159900 对所有非深市成份股进行现金替代，申购和赎回时的替代金额可以不同； 2.4 对申购、赎回规模进行控制；	2.1 开放日为本市场交易日； 2.2 对所有成份股进行股份联动监控（必须现金替代的成份股除外）； 2.3 可以对每一只成份股进行现金替代，申购和赎回时替代金额相同； 2.4 暂未对申购、赎回规模进行控制；
成交回报	3.1 可能有申购超限、赎回超限的回报记录； 3.2 会出现 159900 的资金替代明细记录； 3.3 对非深市成份股进行现金替代时，赎回金额设置为 0，即 159900 的赎回替代金额为 0；	3.1 暂时没有申购超限、赎回超限的撤单回报记录； 3.2 不会出现 159900 的资金替代明细记录； 3.3 如果发生了现金替代，赎回金额不会为 0；
结算模式	4.1 对申购的份额和资金采取担保交收，对赎回份额采取担保交收、对资金采取非担保交收（代收代付）。	4.1 对申购赎回的份额和资金都采取担保交收
申购赎回资金交收流程	5.1 T+N（T 为赎回申请日，N 由基金公司决定）日，基金公司将赎回资金指令发送中国结算深圳分公司。 5.2 T+N+1 日，中国结算深圳分公司进行资金的代收代付。 5.3 若代收代付不成功，基金公司会再次将指令发送中国结算深圳分公司进行代收代付。	5.1 赎回资金采用 T+1DVP 担保交收 5.2 组合券 T 日过户

项目名	跨市场 ETF	现有本市场 ETF
	5.4 不涉及组合券过户 详参上述申购流程和赎回流程	
PCF 文件内容	6.1 “成份股信息”里包含虚拟成份股 159900，非深市成份股； 6.2 有“申购替代金额”和“赎回替代金额”两个字段，分别表示必须现金替代的申购赎回替代金额，值可以不同； 6.3 有“挂牌市场”字段，可以标识成份股挂牌市场	6.1 “成份股信息”里都是深市成份股且不包含虚拟成份股 159900； 6.2 只有“固定替代金额”，表示必须现金替代的申购赎回替代金额； 6.3 无“挂牌市场”字段

四、跨市场 ETF 的主要技术变更

4.1 申购赎回清单

为配合跨市场 ETF 业务，申购赎回清单（以下简称 PCF）的格式和内容做了调整。新格式的 PCF 如下所示，新增字段以红色字体标出。

4.1.1 参数部分字段定义

表 2 跨市场 ETF 的 PCF 参数定义

字段内容	格式	含义	范围
Version	C8	版本号	
FundID	C6	基金代码	[159901, 159999]
FundName	C30	基金名称	
FundManagementCompany	C30	基金公司名称	
UnderlyingIndex	C6	拟合指数代码	对我所分配了代码的指数，取值范围 [000000, 999999]。
CreationRedemptionUnit	C8	每个篮子（最小申购赎回单位）对应的 ETF 份数	[0, 99999999]
Estimatecashcomponent	C11	T 日每个篮子的预估现金差额，总长为 11 位（包括小数点），2 位小数	[-99999999.99, 99999999.99]
MaxCashRatio	C7	最大现金替代比例，总长为 7 位（包括小数点），小数点后 5 位，例如：5.551%在	[0.00001, 1]

字段内容	格式	含义	范围
		文件中用 0.05551 表示	
Publish	C1	是否发布 IOPV, 0: 不发, 1: 发布	{0, 1}
Creation	C1	申购允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
Redemption	C1	赎回允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
CashCreation	C1	现金申购允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
RecordNum	C3	表示一个篮子中的深市成份股数目 (包含 159900 证券)	[0, 999]
TotalRecordNum	C4	表示一个篮子中的所有成份股数目 (包含 159900 证券)	[0, 9999]
Type	C1	ETF 类型, 1: 本市场 ETF, 2: 跨市场 ETF	
TradingDay	C8	T 日日期, 格式 YYYYMMDD	
PreTradingDay	C8	T - 1 日日期, 格式 YYYYMMDD	
CashComponent	C11	T - 1 日申购赎回基准单位的现金余额, 两位小数	[-99999999.99, 99999999.99]
NAVperCU	C12	T - 1 日申购赎回基准单位净值, 总长为 12 位, 包括小数点, 其中小数部分为 2 位。	[0, 999999999.99]
NAV	C8	T - 1 日基金的单位净值。总长为 8 位, 包括小数点, 其中小数部分为 4 位。	[0, 999.9999]
DividendPerCU	C12	T 日申购赎回基准单位的红利金额, 总长为 12 位, 包括小数点, 其中小数部分为 2 位	[0, 999999999.99]
CreationLimit	C12	当天累计可申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制	[0, 999999999999]
RedemptionLimit	C12	当天累计可赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制	[0, 999999999999]

4.1.2 成份股部分字段定义

表 3 跨市场 ETF 的 PCF 中成份股参数定义

字段内容	格式	含义
证券代码	C6	关键字
证券简称	C8	四位中文, 左对齐, 右补空, 对正确性不校验
证券数量	C8	每个申购篮子中该成分股的数量, 数据右对齐, 左补空

字段内容	格式	含义
替代标志	C1	表示该证券是否允许用现金进行替代。 0 表示禁止现金替代（必须有证券），1 表示可以进行现金替代（先用证券，证券不足的话用现金替代），2 表示必须用现金替代。在网页上显示时需要转换成对投资人直观的汉字说明形式（如 0 表示为“禁止替代”）。
溢价比例	C7	证券用现金进行替代的时候，计算价格时增加的比例（不含 100%）。总长为 7 位（包括小数点），小数点后 5 位，数据右对齐，左补空，小数必须为 5 位，例如：2.551% 在文件中用 0.02551 表示；2.1% 在文件中用 0.02100 表示。
申购替代金额	C12	当某只证券必须用现金替代的时候，申购时该证券所需总金额。 总长为 12 位（包括小数点），小数点后 3 位 数据右对齐，左补空，小数必须为 3 位，例如：2000 在文件中用 2000.000 表示
赎回替代金额	C12	当某只证券必须用现金替代的时候，赎回时对应应该证券返还的总金额。 总长为 12 位（包括小数点），小数点后 3 位 数据右对齐，左补空，小数必须为 3 位，例如：2000 在文件中用 2000.000 表示。对于跨市场 ETF，该字段为 0.000
挂牌市场	C8	成份股挂牌市场，市场代码采取 ISO10383 标准，XSHE-深圳市场，XSHG-上海市场，XHKG-香港市场、、

4.1.3 成份股信息

在 PCF “成份股信息”会增加虚拟成份股 159900 的信息，该虚拟成份股的“替代标志”字段为“必须现金替代”，“挂牌市场”字段为“XSHE”，表示该虚拟成份股是深市成份股，在申购赎回时，对该虚拟成份股必须使用现金替代。

在 PCF 里，通常是深市成份股信息排列在前面，其后是非深市成份股。非深市成份股主要揭示给投资者进行申购赎回时参考用。

4.1.4 关于旧格式的 PCF

为减少对从事本市场 ETF 的 PD 券商和基金公司的影响，将会继续保留旧格式的 PCF。从事跨市场 ETF 的 PD 券商和基金公司需要使用新格式的 PCF，从事本市场 ETF 的 PD 券商和基金公司可以继续使用旧格式的 PCF，也可以选择使用新格式的 PCF。未来的趋势是统一 PCF 格式，即今后新发的 ETF 无论是跨市场 ETF 或者本市场 ETF，都将使用新格式的 PCF。

新 PCF 格式完全兼容旧格式，如新格式 PCF 应用于本市场 ETF 业务，则其中的“RecordNum”和“TotalRecordNum”会设置为相等，“Type”设置为“1”，“CreationLimit”和“RedemptionLimit”设置为 0，“申购替代金额”和“赎回替代金额”设置为相等，成份股“挂牌市场”都设置为“XSHE”。

4.2 深交所数据接口规范的调整

为配合跨市场 ETF 业务，深交所和中国结算深圳分公司调整了数据接口规范，主要有：

- 证券信息库 SJSXX.DBF 和新证券信息库 SJSXXN.DBF

若本所未分配跨市场 ETF 跟踪的指数代码，则新证券信息库 SJSXXN.DBF 相应 ETF 记录的 XXJCZQ 字段设置为 0。

通过 SJSXX.DBF 和 SJSXXN.DBF 发布虚拟成份股 159900 的信息，该证券仅限于在申购赎回时用于对跨市场 ETF 中一揽子非深市成份股进行现金替代，不能用于其他业务。该证券的 XXZQJC 字段值为“申赎现金”，XXZQJB 字段值为‘0’（净值揭示服务开放式基金）。

- 成交回报库 SJSHB.DBF

当发生跨市场 ETF 申购业务时，SJSHB.DBF 会出现证券代码为 159900 的回报记录：HBYWLB 字段为“ZB”，HBCJSL 字段存放“篮子数量”，HBCJJG 字段存放“替代金额”。如果 159900 对应的申购替代金额太大，可能拆分资金替代明

细的回报记录。为了尽可能避免拆分记录，若替代金额的第三位小数为 0，则将 HBCJSL 字段设置为“10 * 篮子数量”，而替代金额则除以 10，使得“成交数量 * 成交价格”保持为该笔申购所对应的实际替代金额；然后再判断是否拆分。（参见针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》6.3.1.3 相关内容）

当发生跨市场 ETF 赎回业务时，SJSHB.DBF 也会出现证券代码为 159900 的回报记录：HBYWLB 字段为“ZS”，HBCJSL 字段存放“篮子数量”，HBCJJG 字段设置为 0。按照替代金额=“成交数量”×“成交价格”计算，替代金额为 0，表示赎回时非深市成份股的现金替代金额为 0。

在 SJSHB.DBF 库中新增了“申购超限”和“赎回超限”两类回报。

- 股份结算信息库 SJSGF.DBF

增加‘L9’业务，表示跨市场 ETF 赎回资金。具体定义请见附件二。

- 资金清算库 SJSQS.DBF

增加‘L9’业务，表示跨市场 ETF 赎回资金。具体定义如下表所示：

表 4 清算业务含义表（见数据接口规范表 4-1）

QSYWLB	相应业务含义	说明
L9	跨市场 ETF 赎回资金	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。 卖出金额表示赎回资金。

备注：

上表中 L9 的业务说明是从券商角度来说的，对基金公司来说，上表“说明”一列中，“买入金额”定义的内容，体现在“卖出金额”中，“卖出金额”定义的内容，体现在“买入金额”中。

- 资金结算信息库 SJSZJ.DBF

增加用途代号 C009：

表 5 用途代号含义表（见数据接口规范表 4-2）

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
C009	跨市场 ETF 赎回资金	证券代码

关于接口规范的变更，详见《TS-0409-001 深圳证券交易所数据接口规范（Ver4.57）.doc（征求意见稿）》。

4.3 基金管理人接口规范的调整

修订了中国结算深圳分公司和基金管理公司之间的数据接口，在 GLRQS.DBF 和 GLRFK.DBF 中增加了 ‘ L9 ’ 业务，表述跨市场 ETF 赎回资金，具体请参见：《TS(1)-2009-0001 基金管理人登记结算数据接口规范（Ver 1.1 讨论稿）.doc》

五、 券商系统支持跨市场 ETF 业务的注意事项

从事跨市场 ETF 的 PD 券商的柜台系统需要支持新格式的 PCF。如果某会员同时是跨市场 ETF 和本市场 ETF 的 PD 券商，其柜台系统需要支持新旧格式的 PCF。

中国结算深圳分公司对跨市场 ETF 赎回资金采取非担保交收，PD 券商不应再对赎回资金进行预清算，并且注意在 T+N 日接受中国结算深圳分公司转发的赎回资金清算数据，在 T+N+1 日办理赎回资金代收代付。具体清算数据发送和赎回资金划付的时间取决于基金公司，对于恒指 ETF，通常为 T+3 日发送清算数据，T+4 办理赎回资金划付。

六、 附件一：恒指 ETF 申购赎回清单

（仅做示意，实际数据到时以基金公司发布为准）

[ETFHZ]

Version=2.0

FundID=159904

FundName=恒指 ETF

FundManagementCompany=华夏基金管理有限公司

UnderlyingIndex=HS1

CreationRedemptionUnit=2000000

EstimateCashComponent=-8331.22

MaxCashRatio=1.00000

Publish=1

Creation=1

Redemption=1

CashCreation=0

RecordNum=1

TotalRecordNum=43

Type=2

TradingDay=20091118

PreTradingDay=20091117

CashComponent=-3607.01

NAVperCU=3583289.27

NAV=1.792

DividendPerCU=0.00

CreationLimit=500000000000

RedemptionLimit=500000000000

TAGTAG

159900	申赎现金	2	3950728.550	0.000	XSHE
00001	长江实业	8300	1 0.10000		XHKG
00002	中电控股	25900	1 0.10000		XHKG
00003	中华煤气	1200	1 0.10000		XHKG

00004	九龙仓	2900 1 0.10000		XHKG
00005	汇丰控股	1500 1 0.10000		XHKG
00006	香港电灯	2100 1 0.10000		XHKG
00011	恒生银行	1900 1 0.10000		XHKG
00012	恒基地产	2900 1 0.10000		XHKG
00013	和记黄埔	2600 1 0.10000		XHKG
00016	新鸿基	1400 1 0.10000		XHKG
00017	新世界	1900 1 0.10000		XHKG
00019	太古股份	2000 1 0.10000		XHKG
00023	东亚银行	1500 1 0.10000		XHKG
00066	港铁公司	2700 1 0.10000		XHKG
00083	信和置业	4100 1 0.10000		XHKG
00101	恒隆地产	2100 1 0.10000		XHKG
00144	招商局	6400 1 0.10000		XHKG
00267	中信泰富	2600 1 0.10000		XHKG
00291	华润创业	2500 1 0.10000		XHKG
00293	国泰航空	900 1 0.10000		XHKG
00330	思捷环球	900 1 0.10000		XHKG
00386	中石化	1200 1 0.10000		XHKG
00388	港交所	5900 1 0.10000		XHKG
00494	利丰	1500 1 0.10000		XHKG
00551	裕元集团	1600 1 0.10000		XHKG
00688	中国海外	1100 1 0.10000		XHKG
00700	腾讯控股	2600 1 0.10000		XHKG
00762	中国联通	1800 1 0.10000		XHKG
00857	中国石油	3000 1 0.10000		XHKG
00883	中海洋	3600 1 0.10000		XHKG
00939	建设银行	1300 1 0.10000		XHKG
00941	中国移动	900 1 0.10000		XHKG

01088	中国神华	600	1 0.10000		XHKG	
01199	中远	2200	1 0.10000		XHKG	
01398	工商银行	1700	1 0.10000		XHKG	
02038	富士康	1600	1 0.10000		XHKG	
02318	中国平安	2100	1 0.10000		XHKG	
02388	中银香港	1100	1 0.10000		XHKG	
02600	中国铝业	900	1 0.10000		XHKG	
02628	中国人寿	1600	1 0.10000		XHKG	
03328	交通银行	2100	1 0.10000		XHKG	
03988	中国银行	6300	1 0.10000		XHKG	

ENDENDEND

七、附件二：SJSGF.DBF 中 ‘L9’ 业务详细描述

表 6 业务类别含义表（见数据接口规范表 3-1）

GFYWLB	相应业务含义	GFQRGS			GFZJJE		
L9	跨境 ETF 的赎回资金，投资者应收资金（GFZJJE>0） GFZQDM 为跨市场 ETF 证券代码。 GFSFZH 第 1～8 位表示委托日期，格式是 CCYYMMDD，第 9～17 位表示委托当日的成交号码。		=0		投资者应 收资金	>0	N (请见 备注)

备注：

券商 T 日收到某基金的 ‘L9’ 明细指令后，不记投资者账；

待 T+1 日收到 SJSZJ.DBF 数据后，判断其中是否存在“用途代号”为 C009、“发生证券代码”为该基金代码的资金交收记录，若有，则表示 T 日该批 ‘L9’ 明细指令交收成功，请记投资者账，若无，则表示 T 日该批 ‘L9’ 明细指令交收失败，不记投资者账。

对于交收失败的指令，基金公司日后会再次发给中国结算深圳分公司，中国结算深圳分公司在接收当日，会再次通过 ‘L9’ 业务转发给相关券商。