



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 4.56)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司

二〇〇八年九月

目 录

《接口规范》VER4.56 前言	1
《接口规范》VER4.55 前言	1
关于本文档	3
一、 交易数据接口规范	9
1. 证券信息库SJSXX.DBF	9
2. 新证券信息库SJSXXN.DBF	13
3. 行情库SJSHQ.DBF	21
4. 指数库SJSZS.DBF	24
5. 委托库SJSWT.DBF	25
6. 回报库SJSHB.DBF	29
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. 发行信息库SJSFX.DBF	54
10. 股份结算对帐库SJSDZ.DBF	58
11. 证券交易统计库SJSTJ.DBF	58
12. B股结算指令库SJSZL.DBF	59
13. B股结算指令状态库SJSZT.DBF	60
14. 托管单元信息库SJSXW.DBF	61
15. 代理信息库SJSDL.DBF	62
16. LOF结算信息库LOFJS.DBF	62
四、 资金结算接口规范	66
17. 资金清算库SJSQS.DBF	66
18. 资金结算信息库SJSZJ.DBF	68
五、 开户登记接口规范	75
19. 开户委托库SJSKW.DBF	75
20. 开户回报库SJSKB.DBF	79
21. 开户统计库SJSKT.DBF	81
六、 结算参与人实时传送接口规范	84
22. 非交易报送库FJYBS.DBF	84
23. 非交易确认库FJYQR.DBF	89

《接口规范》Ver4.56 前言

一、 目标说明

根据业务发展需要，对原数据接口规范（Ver4.55）进行调整，具体如下：

1. 拓展了委托库 SJSWT.dbf 委托记录错误代码含义表中的错误代码“H”的业务含义说明。
2. 回报库（SJSHB.dbf）交易主机自动撤单含义表中新增撤单原因代码“46”的业务含义说明；原 Ver4.55 接口规范的修订内容“交易系统网络投票指令的即时处理结果通过回报库 SJSHB.dbf 返回给券商”作废，《交易系统投票结果回报数据接口》的有效版本号仍为 Ver1.02。
3. 股份结算信息库（SJSGF.DBF）中增加限售股份信息的发送（业务类别为“XS”）。
4. 非交易报送库（FJYBS.DBF）和非交易确认库（FJYQR.DBF）中增加债券跨市场转出指令（业务类别为“ZC”）和转托管出错调整指令（业务类别为“ZT”）。

二、 相关事宜

本版规范由深交所电脑工程部和中國結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、25918186（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
二〇〇八年九月二日

《接口规范》Ver4.55 前言

一、 目标说明

根据业务发展需要，原数据接口规范（Ver4.54）进行调整，具体如下：

1. FJYBS.DBF 中增加 ‘S1’、‘S2’ 两类指令分别用于报送 B 股一类指令修改指令和 B 股二类指令。相应地，FJYQR.DBF 中增加 ‘S1’、‘S2’ 和 ‘M2’ 业务，其中前两者表示相应指令的实时有效性检查结果，‘M2’ 表示预配对处理结果。增加 B04、E69、E70、E71 几个错误代码。

2. 将发行业务的数据接口从股份结算信息库（SJSGF.dbf）独立出来，形成独立的发行信息库（SJSFX.dbf）。

3. 废除结算参与人文件传送数据接口规范，将冻结业务的相关数据接口转移到结算参与人实时传送接口规范当中去。

4. 拓展了回报库（SJSHB.dbf）交易主机自动撤单含义表中的撤单原因代码“01”、“09”和“45”的业务含义说明；明确交易系统网络投票指令的即时处理结果通过回报库 SJSHB.dbf 返回给券商，但其最终处理结果以深交所《交易系统投票结果回报数据接口》（Ver1.03）约定的数据库 SJSTP.dbf 中的回报数据为准。

5. 证券信息库 SJSXX.dbf 和新证券信息库 SJSXXN.dbf 中增加了创业板网络投票的证券代码说明。

6. 行情库 SJSHQ.dbf 中新增创业板成交量指标 395004，395001 成交量指标更名并调整统计口径，395002、395003 成交量指标更名。

7. 信息公告文件的主题词说明中增加创业板交易公开信息。

二、 相关事宜

本版规范由深交所电脑工程部和中國結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、25918186（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
二〇〇八年四月二日

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	<p>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、上市公司流通股要约收购等业务，进行了修订，形成 Ver4.1。主要修订如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 WHTXHX 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	<p>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》（Ver4.1）进行了修订和整合，形成了Ver4.2。主要修订如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本版本接口规范继承了《深圳证券交易所数据接口规范》（Ver4.1）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》（Ver3.2）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	<p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 对委托库 SJSWT.DBF 的说明进行了修订，增加了关于进行 LOF 跨系统

日期	版本	修订说明
		<p>转托管的报盘说明。</p> <p>2. 对股份结算信息库 SJSJGF.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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>5. 增加了一个代理信息库 SJSJDL.DBF,供券商办理 LOF 跨系统转托管业务时使用。</p>
2004-12	Ver 4.32	<p>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:</p> <p>1. 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。</p> <p>2. 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。</p>
2005-03	Ver 4.33	<p>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:</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2005-09	Ver 4.34	<p>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:</p> <p>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。</p> <p>股份结算接口规范方面,修订了股份结算信息库SJSJGF.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SJSJDL.DBF中总持股数的定义</p> <p>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。</p>
2005-11	Ver 4.35	<p>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:</p> <p>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</p>

日期	版本	修订说明
		<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2006-03	Ver 4.36	<p>在前一版本基础上, 为了配合开展协助司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:</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
2006-04	Ver 4.37	<p>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:</p> <p>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。</p> <p>修订了SJSGF.DBF, 增加了关于转入、转出质押库回报的说明。</p> <p>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。</p>
2006-06	Ver 4.38	<p>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:</p> <p>修订了委托库SJSWT.DBF, 增加了新股申购撤单业务类别。</p> <p>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。</p>
2006-06	Ver 4.39	<p>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:</p> <p>修订了SJSWT.DBF, 增加了关于融资融券交易的委托说明。</p> <p>修订了SJSHB.DBF, 增加部分自动撤单定义。</p> <p>修订了SJSGF.DBF, 增加了相关业务类别。</p> <p>修订了SJSXW.DBF, 增加了信用席位的信息。</p> <p>修订了SJSKW.DBF, 增加了两类开户类别。</p> <p>增加了结算参与人实时传送接口规范。</p>
2006-07	Ver 4.50	<p>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:</p>

日期	版本	修订说明
		<p>增加了SJSXM.DBF。</p> <p>修订了SJSTJ.DBF，调整了TJBGHF和TJSGHF的字段定义。</p> <p>修订了SJSJG.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。</p> <p>修订了SJSQS.DBF，增加了相关业务的说明。</p> <p>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。</p> <p>增加了部分错误代码解释和资金用途解释。</p>
2006-08	Ver 4.51	<p>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：</p> <p>修订了SJSXX.DBF中XXZQJB字段取值含义。</p> <p>增加了SJSXXN.DBF。</p> <p>修订了SJSHQ.DBF首条特殊记录的部分字段说明。</p> <p>增加了信息公告接口约定。</p> <p>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。</p>
2006-12	Ver4.52	<p>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：</p> <p>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；</p> <p>修订了T+1DVP相关的内容，修订后本接口不再含有T+1DVP内容；</p> <p>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SJSJG.DBF中对新股发行上网定价方式相关日期的说明；</p> <p>FJYBS.DBF增加了沪市账户挂账股份补登记业务的相关说明。</p>
2007-4	Ver4.53	<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p>

日期	版本	修订说明
		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。 修订SJSGF.dbf中关于“LOF/ETF连续认购方式”的发行数据说明。
2007-10	Ver4.54	<p>在前一版本基础上，因业务需要进行了修订，形成Ver4.54，主要修订如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 交易接口中，“席位”变更为“交易单元”； 2. 改原“股份结算席位”为“托管单元”，改原“席位代码”为“托管编码”，改原“资金结算主席位”为“结算账户”； 3. 增加（配股）退款退息接口，SJSGF.DBF中增加业务类别29； 4. SJSKB.DBF中，针对股东资料查询业务（业务类别‘17’），摘要代号增加K51-休眠、K52-不合格； <p>SJSKW.DBF和SJSKB.DBF增加休眠账户激活业务（业务类别‘19’）； 因公司债、资产证券化业务需要，SJSGF.DBF中增加‘B9’业务用于下发交收失败数据，对资产证券化业务，不再借用‘41’业务发送交收成功数据；SJSQS.DBF中‘00’业务增加公司债集中竞价交易数据（QSZQDH=‘1C’），增加‘DZ’业务用于传送大宗交易平台非担保清算数据（目前包括公司债大宗交易、资产证券化及中关村园区）。 补充D68-D71、E68等错误代号解释；补充K43、K44开户回报摘要代号增加若干资金用途代号（D206、G206、G207、H223、H030、H045、J013、J014、J210）；扩展若干资金用途代号在用途含义表中ZJZQDM的解释（C002、G009、H002）。</p>
2008-4	Ver4.55	<p>在前一版本基础上，因业务需要进行了修订，形成Ver4.55，主要修订如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. FJYBS.DBF中增加‘S1’、‘S2’两类指令分别用于报送B股一类指令修改指令和B股二类指令；相应地，FJYQR.DBF中增加‘S1’、‘S2’和‘M2’业务，其中前两者表示相应指令的实时有效性检查结果，‘M2’表示预配对处理结果。增加B04、E69、E70、E71几个错误代码。 2. 将发行业务的数据接口从股份结算信息库（SJSGF.dbf）独立出来，形成独立的发行信息库（SJSFX.dbf）。 3. 结算参与人文件传送数据接口规范，将冻结业务的相关数据接口转移到结算参与人实时传送接口规范当中去。 4. 拓展了回报库（SJSHB.dbf）交易主机自动撤单含义表中的撤单原因代码“01”、“09”和“45”的业务含义说明；明确交易系统网络投票指令的即时处理结果通过回报库SJSHB.dbf返回给券商。 5. 证券信息库SJSXX.dbf和新证券信息库SJSXXN.dbf中增加了创业板网络投票的证券代码说明。 6. 行情库SJSHQ.dbf中新增创业板成交量指标395004，395001成交量指标更名并调整统计口径，395002、395003成交量指标更名。 7. 信息公告文件的主题词说明中增加创业板交易公开信息。 <p>其中，后四点调整的启用日期另行通知。</p>
2008-9	Ver4.56	<p>在前一版本基础上，因业务需要进行了修订，形成Ver4.56，主要修订如下：</p>

日期	版本	修订说明
		<p>1. 拓展了委托库SJSWT.dbf委托记录错误代码含义表中的错误代码“H”的业务含义说明。</p> <p>2. 回报库（SJSHB.dbf）的交易主机自动撤单含义表中新增撤单原因代码“46”的业务含义说明；原Ver4.55接口规范的修订内容“交易系统网络投票指令的即时处理结果通过回报库SJSHB.dbf返回给券商”作废，《交易系统投票结果回报数据接口》的有效版本号仍为Ver1.02。</p> <p>3. 股份结算信息库（SJSGF.DBF）中增加限售股份信息的发送（业务类别为“XS”）。</p> <p>4. 非交易报送库（FJYBS.DBF）和非交易确认库（FJYQR.DBF）中增加债券跨市场转出指令（业务类别为“ZC”）和转托管出错调整指令（业务类别为“ZT”）。</p>

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。

证券类别定义表 (表 1-1)

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

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, 【112000, 112999】是公司债的证券代码区间; 【115000, 115999】是分离交易型可转债的证券代码区间; 【119000, 119999】是资产证券化产品的证券代码区间;

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‘0’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; 创业板网络投票的证券代码使用【365000, 368999】区间, 根据创业板股票的交易代码顺序编码, 如 300001 证券的网络投票代码为 365001、301001 的网络投票代码为 366001, 依次类推。

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“NNNNNSYYMMDDYYMMDD”, 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) XXMGZ (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: $[\text{MAX}(XXJGDW, SJSWQ.HQZRSP - ((SJSWQ.HQZRSP - 1) * XXXJXZ + 1) * XXJHCS), SJSWQ.HQZRSP + ((SJSWQ.HQZRSP - 1) * XXXJXZ + 1) * XXJHCS]$

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: $[\text{MAX}(XXJGDW, SJSWQ.HQZJCJ - ((SJSWQ.HQZJCJ - 1) * XXXJXZ + 1) * XXLXCS), SJSWQ.HQZJCJ + ((SJSWQ.HQZJCJ - 1) * XXXJXZ + 1) * XXLXCS]$, 如 STSHQ.HQZJCJ 值为 0, 则用 SJSWQ.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	C	6	
2	XXZQJC	证券简称	C	8	
3	XXJCQZ	证券简称前缀	C	4	
4	XXYWJC	英文简称	C	20	
5	XXJCZQ	基础证券	C	6	
6	XXISIN	ISIN 编码	C	12	
7	XXHYZL	行业种类	C	3	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
8	XXHBZL	货币种类	C	2	
9	XXMGZ	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	
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	C	1	
37	XXCFBZ	成份股标志	C	1	
38	XXZSBZ	做市商标志	C	1	
39	XXSCDM	所属市场代码	C	2	预留
40	XXZQLB	证券类别	C	4	CFIcode, 预留
41	XXZQJB	证券级别	C	1	
42	XXZQZT	证券状态	C	1	
43	XXJY LX	交易类型	C	1	
44	XXJYJD	产品交易阶段	C	1	
45	XXTPBZ	暂停交易标志	C	1	
46	XXRZZT	融资交易状态	C	1	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
47	XXRQZT	融券交易状态	C	1	
48	XXRQJX	融券卖出价格限制	C	1	
49	XXWLTP	网络投票标志	C	1	
50	XXYWZT	其他业务状态	C	8	
51	XXGXSJ	记录更新时间	C	6	HHMMSS
52	XXMARK	备用字段	C	12	预留
53	XXBYBZ	备用标志	C	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。

证券类别定义表 (表 1-2)

第一位	第二位	定义
0	0	A 股证券
	3	A 股认购或认沽权证 (注 1)
	7	A 股增发
	8	A 股配股权证
1	0	国债现货
	1	债券 (注 2)
	2	可转换债券
	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
	8	B 股配股权证
3	0	创业板证券
	6	网络投票证券 (注 4)
	7	创业板增发

第一位	第二位	定义
	8	创业板配股权证
	9	综合或成份指数/成交量统计指标（注 5）

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:【112000, 112999】是公司债的证券代码区间;【115000, 115999】是分离交易型可转债的证券代码区间;【119000, 119999】是资产证券化产品的证券代码区间;

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; 创业板网络投票的证券代码使用【365000, 368999】区间, 根据创业板股票的交易代码顺序编码, 如 300001 证券的网络投票代码为 365001、301001 的网络投票代码为 366001, 依次类推。

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
第一位	Y	整天停牌 (不接受申报)
	H	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)
第二位	C	仅可融资
	S	仅可融券
	A	既可融资也可融券
	.	其他 (注意是英文小数点字符)
第三位	N	股票: 新股上市首日 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

	取值	定义
	J	公司再融资（包括增发、配股、可转债发行等）通过交易系统公开发行人申购期间（仅 A、B 股标记，以基础证券为准）
	X	股票、债券、基金：除权除息 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
	W	权证：当日可行权 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）
第四位	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
	C	封闭式基金
	O	开放式基金（仅揭示净值）
	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）
	E	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“NNNNNSYYMMDDYYMMDD”，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。

（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) XXMGZ (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: $[\text{MAX}(XXJGDW, SJSWQ.HQZRSP - ((SJSWQ.HQZRSP - 1) * XXXJXZ + 1) * XXJHCS), SJSWQ.HQZRSP + ((SJSWQ.HQZRSP - 1) * XXXJXZ + 1) * XXJHCS]$

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: $[\text{MAX}(XXJGDW, SJSWQ.HQZJCJ - ((SJSWQ.HQZJCJ - 1) * XXXJXZ + 1) * XXLXCS), SJSWQ.HQZJCJ + ((SJSWQ.HQZJCJ - 1) * XXXJXZ + 1) * XXLXCS]$, 如 STSHQ.HQZJCJ 值为 0, 则用 SJSWQ.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) XXJYJD(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) XXRJX(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	‘T’: 处于行权期; ‘F’: 不处于行权期	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	HQJRP	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	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
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	价格涨跌 1	N	9, 3	
14	HQJSD2	价格涨跌 2	N	9, 3	
15	HQHYCC	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	
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、HQRKP、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: 涨跌一) = HQZJCJ (字段 5: 最近成交价) - HQZRSP (字段 3: 昨收盘价)。

(7) HQJSD2 (字段 14: 涨跌二) = HQZJCJ (最近成交价) - 上笔成交价。

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

(8) HQHYCC (字段 15: 合约持仓量), 对于同时在深交所、银行间市场挂牌的国债和企业债, 存放该债券的估值。

(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 (HQB JW1, 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	主板 A 股	不含中小板、创业板的所有 A 股的成交量
2	395002	主板 B 股	所有 B 股的成交量
3	395003	中小板	所有中小企业板块股票的成交量
4	395004	创业板	所有创业板股票的成交量
5	395011	封闭基金	所有封闭式基金的成交量
6	395012	LOFs	所有 LOF 的成交量，但不含非上市的部分
7	395013	ETFs	所有 ETF 的成交量
8	395021	可转债	所有可转债的成交量
9	395022	企债现券	所有企业债现券的成交量
10	395023	企债回购	所有企业债回购的成交量
11	395031	国债现券	所有国债现券的成交量
12	395032	国债回购	所有国债回购的成交量
13	395041	股票权证	所有以股票为标的的权证的成交量
14	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	C	6	
2	ZSZSQC	指数全称	C	12	
3	ZSYWMC	英文名称	C	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 ZSZSQC 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	
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	C	1	
9	WTMARK	备用字段	C	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) 左六位为表示交易单元代码的数字串。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交易单元代码, 存放格式如 0xxxx.xx0, 填 ‘x’ 的位置即为交易单元代码; 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’), 若转入方的交易单元代码 (通常为托管单元代码) 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）托管在该交易单元（在 WHTX 中）对应托管单元下的所有证券都要求转至新交易单元（在 WTWTJG 中）对应托管单元；若 WTWTSL=0，表示该证券账户托管在该交易单元对应托管单元下的该证券（WTZQDM）的全部持有量都转至新交易单元对应托管单元。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“36xxxx”，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。

委托业务类别含义表（表 1-6）

WTYWL	委托业务含义	WTWTS	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，转出交易单元代码在 WTHTXH 中	等于 0 表示全额转托管本证券	存放转入交易单元代码（通常即为托管编码）
3C	转托管业务中撤单委托记录		=0
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托记录		0
AB	无股份冻结质押业务中质权人的申报记录。对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中	>0	对应出质人的交易单元代码
AS	无股份冻结质押业务中出质人的申报记录。对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中。若是债券转入质押库的申报，则质权人交易单元代码固定填 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’。		对应质权人的交易单元代码
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。对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中	>0	对应出质人的交易单元代码
BS	股份质押且冻结业务中出质人的申报记录。对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中		对应质权人的交易单元代码
BC	股份质押且冻结业务中撤单委托记录		=0
CB	无股份冻结解押业务中出质人的申报记录。对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中。若是	>0	对应质权人的交易单元代码

WTYWL	委托业务含义	WTWTS	WTWTJG
	债券转出质押库的申报, 则质权人交易单元代码固定填 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。对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中		对应出质人的交易单元代码
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。对应质权人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中	>0	对应质权人的交易单元代码
DS	股份解押且解冻业务中质权人的申报记录。对应出质人的交易单元代码须填在 WTWTJG 中		对应出质人的交易单元代码
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记录		=0
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	交易单元代码非法
B	委托日期非法
D	证券代码非法
E	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；
G	委托价格不是 SJSXX.XXJGDW 的整数倍
H	证券账户含有非数字字符；或 合同序号 WTHTXH 的第 15 至第 22 位含有非法字符
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	该交易单元无权经营该种证券
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	交易单元被禁买或禁卖
R	证券账户被禁买或禁卖
W	交易单元资金可用量不足
X	该委托记录标有 DELETE 标记

6. 回报库 SJS HB.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	HBCJHM	成交号码	C	8	数字字符串
2	HBZQDM	证券代码	C	6	
3	HBHTXH	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	对方交易单元	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	HBWLB	业务类别	C	2	
12	HBCDYY	撤单原因	C	2	
13	HBMARK	备用字段	C	2	融资融券相关标识

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
14	HBBYBZ	备用标志	C	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因的自动撤单回报记录	<0	=0
3S	转托管申报被接受的回应记录, 转入交易单元代码在 HBDFXW 中。	≥0	=0
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记录。出质人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	=0
AS	无股份冻结质押业务中出质人申报被接受的回应记录。质权人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	
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记录。出质人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	=0
BS	股份质押且冻结业务中出质人申报被接受的回应记录。质权人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	
BC	股份质押且冻结业务撤单回报记录	≤0	
CB	无股份冻结解押业务中出质人申报被接受的回应记录。质权人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	=0

HBYWLB	交易回报业务含义	HBCJSL	HBCJJG
CS	无股份冻结解押业务中质权人申报被接受的回应记录。出质人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	
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记录。质权人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	=0
DS	股份解押且解冻业务中质权人申报被接受的回应记录。出质人交易单元代码在 HBDFXW 中。	>0	=0
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的回应记录	>0	=0
EC	流通股份要约收购业务中的预受要约撤单回报记录	≤0	
FS	流通股份要约收购业务中的解除预受要约申报被接受的回应记录	>0	=0
FC	流通股份要约收购业务中的解除预受要约撤单回报记录	≤0	
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 ETF 基金赎回成功证券给付明细回报记录	>0	=0
KS	ETF 基金申购成功股份交付明细记录或 ETF 基金赎回成功回报记录	>0	=0
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”未能成交部分的自动撤单或其他原因的自动撤单回报记录	<0	=0
WC	“全额成交或撤销委托”未能成交时的自动撤单或其他原因自动撤单回报记录	<0	=0
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 ETF 基金申购成功必须现金替代明细回报记录	>0	>0
ZS	ETF 基金赎回成功必须现金替代证券的现金给付明细记录	>0	>0

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: 对方交易单元) 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 为转入交易单元代码; 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)。

交易主机自动撤单含义表 (表 1-9)

HBCDYY	HBDFGD	具体含义
01	无效账户	证券账户无效 (如不合格证券账户等)
02	回购卖空	交易单元对应托管单元拥有的回购虚拟券数量小于卖出委托数量
03	单元卖空	交易单元对应托管单元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 买入创业板股票的申报数量不符合规定
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

HBCDYY	HBDFGD	具体含义
		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	无效单元	该交易单元无权经营该业务 该交易单元融资/融券业务权限被暂停或 信用证券账户不能在普通交易单元上进行交易
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、证券账户交易受限等）
46	市价撤单	申报市价委托时因无法成交（注 ¹ ）而导致交易主机生成的自动撤单记录
99	其他错误	因其他原因导致的交易主机自动撤单

注¹：申报市价委托时无法成交的情形包括：

- 本方最优价格委托：本方无有效委托
- 对手方最优价格委托：对手方无有效委托
- 即时成交剩余撤销委托：部分成交后的剩余部分
- 最优五档即时成交剩余撤销委托：部分成交后的剩余部分
- 全额成交或撤销委托：无法全额成交

(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“OB”，则第 2 笔为“OS”）。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

(1) 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。

信息公告文件命名示例（表 2-1）

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

(2) 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

(3) 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
	信息公告	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
		创业板交易公开信息	公开信息, 创业板
		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券信息	融资融券, 可充抵保证金证券
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, 当同一公司有多证券时, 证券代码之间用“,”分隔。)

(4) 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）。

● 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)

● 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)

● 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

● 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

三、股份结算接口规范

本部分接口规范包括股份结算信息库(SJSGF.dbf)、发行信息库(SJSFX.dbf)、股份结算对帐库(SJSDZ.dbf)、证券交易统计库(SJSTJ.dbf)、托管单元信息库(SJSXW.dbf)和 LOF 结算信息库(LOFJS.dbf)六个接口库,前五个是 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、发行信息库、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托管单元传送一次,同时存放一份于相应托管单元在深交所通信主机上的信箱内;托管单元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。

本部分接口规范中托管编码是指股份所托管的托管单元的代码。

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	托管编码	C	6	
2	GFZQDM	证券代码	C	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	C	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	C	3	
11	GFFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
12	GFBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) GFXWDM(字段 1: 托管编码)、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 6-4。

(5) GFYWLB(字段 4: 业务类别), 本字段的定义(见表 3-1)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 3-1 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 3-1）

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			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	红股到帐及股息派发	红股到帐	红股股数	>0	Y		=0	N
		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。	确认张数	<0	Y	认购款	<0	Y
		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	转托管业务中转出托管单元的记录	GFQRGS<0 表示转托管成功	转出股数	<0	Y		=0	
		GFQRGS=0 表示转托管不成功		=0			=0	
26	转托管业务中转入托管单元的记录		转入股数	>0	Y		=0	
29	退款退息明细	GFSEZH 左起第 1-8 位为认购日期, 格式为 CCYYMMDD; GFWTGS = 退息金额 × 1000; GFZJJE = 退款本金 + 退息金额	确认股数	≥0	N	退款本金和退息金额之和	>0	Y
30	可转债转股(含报盘自愿转股和强	GFQRGS<0, 为确认债券记录	转债张数	<0	Y		=0	
		GFQRGS=0, 为报盘不确认债券记录		=0			=0	

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
	制性转股)	GFQRGS>0, 为股票记录。转换后的零债折算成现金在 GFZJJE 中返还	股票股数	>0	Y	零债现金	≥0	Y
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	
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, 为受让方股东记录	受让股数	>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。GFZQDM 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。 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。如果冻结截止日为空, 则表示无限期冻结。 GFWTXH, 如果空则表示该笔冻结是在结算公司办理的或是已冻结		实际冻结股数	>0	N	原轮候序号	>0	

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
	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。 GFSFZH，第 1~10 位表示原始冻结序号。 GFWTXH，如果空则表示该笔解冻是在结算公司办理的。		实际解冻股数	>0	N			
7C	流通股续冻。 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，如果空则表示该笔续冻是在结算公司办理的。			=0	N			
7D	流通股冻结轮候。 GFSFZH，第 1~10 位表示轮候序号，第 19~20 位表示确认的轮候期限，单位为月，最大轮候冻结期限为 99 个月。 GFWTXH，如果空则表示该笔轮候冻结是在结算公司办理的。		实际冻结轮候股数	>0	N			
7E	流通股冻结轮候解除。 GFSFZH，第 1~10 位表示轮候序号。 GFWTXH，如果空则表示该笔轮候解除是在结算公司办理的。			=0	N			
70	无股份冻结质押	GFQRGS<0，为出质人确认记录 转入债券质押库时，GFQRGS 为转入质押库的 债券张数	质押股数	<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	

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
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 转出债券质押库时, GFQRGS 为转出质押库的 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	解押股数	≥0	Y		≥0	Y
73	股份解押且解冻	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	
76	预受要约确认。 GFSFZH 左 6 位为 收购人编码, 右补 空格。	GFQRGS<0, 为预受要约确认记录	预受要约股数	<0	Y		=0	
		GFQRGS=0, 为预受要约不确认记录		=0			=0	
77	解除预受要约确 认 GFSFZH 左 6 位 为收购人编码, 右 补空格。	GFQRGS>0, 为解除预受要约确认记录	解除预受要约股数	>0	Y		=0	
		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 收购人编码, 右补 空格。	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
						受让方应付 转让金额	<0	Y
Z2	T 日 B 股成交资料 (发给券商及指 定托管银行)	GFQRGS>0, 为买入记录	买入股数	>0	N	成交价格	>0	N
		GFQRGS<0, 为卖出记录	卖出股数	<0	N			

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
Z3	T-2 日 B 股成交资料（发给券商）	GFQRGS>0, 为买入记录	买入股数	>0	Y	成交价格	>0	N
		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
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=B1）+冻结总股数。GFWTGS 为 0。		总股数	>0	N		=0	
B3	<p>卖空记录。GFWTGS 为该托管单元当日卖空股数（包括“中途先行卖空”股数），营业部要据此交纳罚金。GFQRGS 为累计卖空未补购股数。</p> <p>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。</p> <p>如果 GFZQDM 为 131991，则 GFQRGS 表示质押库欠库的企业债回购标准券的张数。</p>		累计未补购卖空股数	<0	N		=0	N
B4	债券未到期回购合约。 GFGDDM 为空，GFSFZH 左 22 位为合同序号。	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				
B5	无效证券账户挂帐		挂帐股数	>0	N		=0	N
B6	保管股份余额记录		投资者保管股份总额	>0	N		=0	N
B7	QFII 对帐数据。由于 QFII 的股份托管在银行托管单元下，本记录向需要对帐的券商提供 QFII 的股份余额数据。		QFII 股份余额	>0	N		=0	N
B8	<p>资金交收违约的待处分证券回报。</p> <p>GFWTGS=0, GFQRGS 为待处分证券股份数量。</p> <p>GFSFZH 第 1~8 位表示成交日期，格式是 CCYYMMDD，第 9~17 位，表示成交当日的成交号码。</p>		待处分证券股数	<0	Y	成交价格	>0	N

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
B9	非担保交收失败数据回报。(用于公司债大宗交易和资产证券化) GFWTGS=0, GFQRGS 为交收失败股数, 大于 0 表示卖方, 小于 0 表示买方。 GFSFZH 第 1~8 位表示成交日期, 格式是 CCYYMMDD, 第 9~17 位, 表示成交当日的成交号码。		交收失败股数	>0 或 <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
XS	限售股份信息 GFKSFZH 复用为“限售股份性质+股份性质的含义”, 左对齐, 右补空格。左数 2 位字符为限售股份性质, 从左数第三位起为限售股份性质的含义。		限售股数	>0	N			
OB	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		
OS	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, 则回报记录有错误代码, GFCWDH 不空。	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
		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 <0, 应付	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证交收回报。未完成交收的,	GFQRGS<0, 标的证券记减	过户股数	<0	Y			
		GFQRGS<0, 权证记减	实际交收股数	≤0	Y	应收资金	≥0	Y

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
	GFQRGS 为 0, GFCWDH 不空。					(已扣税费)		
W3	T+1 日以现金结算的认购权证交收回报。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	应付资金 (已扣税费)	≥0	Y
W4	T+1 日以证券给付结算的认购权证交收回报。未完成交收的, GFQRGS 为 0, GFCWDH 空。	GFQRGS>0, 标的证券记加	过户股数	>0	Y			
		GFQRGS<0, 权证记减	实际交收股数	≤0	Y	应付资金 (已扣税费)	≤0	Y
W5	权证卖空代为补入记录。GFWTXH 为空。		代为补入股数	>0	Y			
L7	T-1 日 ETF 申购/赎回的现金差额。 GFZQDM 为 ETF 证券代码。 GFZJJE>0, 则投资者应收资金, 否则投资者应付资金。			=0		现金差额	>0 应收 <0 应付	Y
L8	ETF 现金替代的多退少补。 GFZJJE>0, 则退给投资者资金, 否则投资者应补交资金。 GFZQDM 为 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, 第 25~30 位表示现金替代的组合证券的证券代码。			=0		>0 表示退款 <0 表示补款	>0 应收 <0 应付	Y
R1	担保证券提交与返还	GFQRGS<0, 为划出方记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10 位)为划入方股东代码, 最后后 6 位(25~30 位)为划入方托管编码。	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, 最后后 6 位(25~30 位)为划出方托管编码。	划入股数	>0	Y		=0	
R2	融券券源划拨	GFQRGS<0, 为划出方记录, GFSFZH 的前 10 位(1~10 位)为划入方股东代码, 最后后 6 位(25~30 位)为划入	划出股数	<0	Y		=0	

GFYWLB	相应业务含义		GFQRGS			GFZJJE		
		方托管编码。						
		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)为划出方托管编码。	划入股数	>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	

(1) 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, GFWTGS=0, GFSFZH 为空; 在发送给托管银行的成交资料中, GFWTGS=0, GFSFZH 为空, GFSFZH 左边 6 位为券商托管编码, 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, GFWTGS=0, 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”表示托管编码无效；
 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”表示对手方托管编码无效；
 21-22 位等于“57”表示托管编码等于对手方托管编码；
 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。

(2) QFII 成交结算数据

GFYWLB=‘0S’或‘0B’：GFXWDM=托管人结算编号，GFGDDM=合格境外投资者证券账户，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交易单元的数字串，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，GFFSRQ=成交日期。

(3) QFII 的 ETF 申购赎回数据（表 3-2）

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（表 3-3）

日期	业务类别 GFYWLB	说明
T 日 (委托日)	W0, 行权申请回报	结算公司收到全部行权申请记录。 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 (交收日)	W1, 以现金方式结算的认沽权证交收回报	GFZQDM 为权证代号。 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。

日期	业务类别 GFYWLB	说明
		<p>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。</p> <p>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。</p> <p>如果是到期自动行权, 则 GFSFZH 为空。</p>
	W3, 以现金方式结算的认购权证交收回报。	<p>GFZQDM 为权证代号。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>如果是到期自动行权, 则 GFSFZH 为空。</p>
	W2, 以证券给付方式结算的认沽权证交收回报	<p>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。</p> <p>GFZQDM 为权证代号时:</p> <p>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。</p> <p>GFZQDM 为标的证券时, GFWTGS=0:</p> <p>GFQRGS<0, 表示扣除该数量的标的证券, 应记减。</p> <p>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。</p>
	W4, 以证券给付方式结算的认购权证交收回报	<p>GFQRGS=0 表示交收失败, 否则表示行权成功。</p> <p>GFZQDM 为权证代号时:</p> <p>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。</p> <p>GFZQDM 为标的证券时, GFWTGS=0:</p>

日期	业务类别 GFYWLB	说明
		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 (表 3-4)

违约情况	业务类别 GFYWLB	说明
权证卖空, 结算公司 代为补入	B3, 卖空	权证卖空, GFZQDM 为权证代码。
	W5, 代为补入结果	权证数量增加。
标的证券卖空, 结算 公司代为行权	B3, 卖空	标的证券卖空, GFZQDM 为标的证券。
	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: (表 3-5)

违约情况	业务类别 GFYWLB	说明
ETF 卖空, 结算公司 代为补入	B3, 卖空	ETF 卖空, GFZQDM 为 ETF 的证券代码。
	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 (表 3-6)

要约收购结果	业务类别 GFYWLB	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. 发行信息库 SJSFX.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	FXXWDM	席位代码	C	6	
2	FXZQDM	证券代码	C	6	
3	FXGDDM	证券账户	C	10	
4	FXYWLB	业务类别	C	2	
5	FXSFZH	身份证号/注册号码	C	30	备用
6	FXWTXH	委托序号	C	8	
7	FXWTGS	委托股数	N	12, 0	
8	FXQRGS	确认股数	N	12, 0	
9	FXZJJE	资金金额	N	15, 3	
10	FXCWDH	错误代号	C	3	
11	FXFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
12	FXBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本接口与 SJSGF.DBF 中各字段仅仅是字段名前两位字符不同, 其余说明相同, 具体请参见 SJSGF.dbf。

业务类别 (FXYWLB) 的含义见表 3-7: :

发行业务类别表（表 3-7）

FXYWLB	相应业务含义	FXQRGS			FXZJJE		
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 FXCWDH 为不确认原因。	不确认股数	>0	N	申购价格	≥0	N
A2	新股申购配号记录。FXWTGS 存放起始配号，FXQRGS 存放包括起始号在内的连续配号个数。（FXWTGS+FXQRGS -1 即为截止号）	配号个数	>0	N		=0	N
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。FXWTGS 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。	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。FXWTGS 为认购委托股数。	确认股数	≥0	N	认购价格	>0	N

新股发行返回数据说明：

市值配售方式：（T 日为申购日）（表 3-8）

日期	业务类别 FXYWLB	说明
T-2 日	A4，投资者可申购记录	若同一投资者在不同托管单元托管有股份，则每个托管单元均会收到该投资者的可申购量，且相同。
T 日 （申购日）	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，FXQRGS=不确认股数，FXZJJE=0，FXCWDH=不确认原因代号
	A2，配号记录	FXWTGS=起始配号，FXQRGS=连续配号个数，FXZJJE=0。 投资者若超额申购，则只返回确认的配号数量。
T+1 日 （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，FXWTGS=中签号码，FXQRGS=中签股数，FXZJJE=0。
T+3 日 （放弃日）	A5，市值配售确认记录	FXWTGS=中签股数，FXQRGS=最终确认股数（若申报了放弃认购股数，则 FXQRGS=FXWTGS- 放弃认购股数，否则 FXQRGS=FXWTGS）；FXZJJE=认购价格；FXQRGS*FXZJJE=最终应扣资金；FXWTXH=空格；

上网定价方式: (表 3-9)

日期	业务类别 FXYWLB	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, $FXQRGS = \text{申购股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{冻结资金}$ 。
	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, $FXQRGS = \text{不确认股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXCWDH = \text{不确认原因代号}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{解冻资金}$ 。
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, $FXQRGS = \text{不确认股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXCWDH = \text{不确认原因代号}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{解冻资金}$ 。
	A2, 配号记录	$FXWTGS = \text{起始配号}$, $FXQRGS = \text{连续配号个数}$, $FXZJJE = 0$ 。
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, $FXWTGS = \text{中签号码}$, $FXQRGS = \text{中签股数}$, $FXZJJE = \text{确认价格}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{最终应扣资金}$ 。
	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, $FXQRGS = \text{申购股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{解冻资金}$ 。

增发定价/竞价方式: (T 日为申购日) (表 3-10)

日期	业务类别 FXYWLB	说明
权益登记日	A4, 老股东优先可配售记录	若同一投资者在不同托管单元托管有股份, 则每个托管单元均会收到该投资者的可申购量, 且相同。
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, $FXQRGS = \text{申购股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{冻结资金}$ 。
	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, $FXQRGS = \text{不确认股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXCWDH = \text{不确认原因代号}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{解冻资金}$ 。
验资处理日	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, $FXQRGS = \text{不确认股数}$, $FXZJJE = \text{申购价格}$, $FXCWDH = \text{不确认原因代号}$, $FXQRGS * FXZJJE = \text{解冻资金}$ 。

日期	业务类别 FXYWLB	说明
比例配售日	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。其中,FXWTGS=0,FXQRGS=获配股数,FXZJJE=配售价格,FXQRGS*FXZJJE=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,FXQRGS=申购股数,FXZJJE=申购价格,FXQRGS*FXZJJE=解冻资金。

LOF/ETF 连续认购方式:(T 日为申购日)(表 3-11)

日期	业务类别 FXYWLB	说明
T 日 (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,FXQRGS=申购股数,FXZJJE=申购价格,FXQRGS*FXZJJE=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,FXQRGS=不确认股数,FXZJJE=申购价格,FXCWDH=不确认原因代号,FXQRGS*FXZJJE=解冻资金。
T+2 日 (认购日)	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,券商可据此解冻相应的投资者申购资金。其中,FXQRGS=不确认股数,FXZJJE=申购价格,FXCWDH=不确认原因代号,FXQRGS*FXZJJE=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,FXWTGS=0,FXQRGS=认购股数,FXZJJE=认购价格,FXQRGS*FXZJJE=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,FXQRGS=申购股数,FXZJJE=申购价格,FXQRGS*FXZJJE=解冻资金。

10. 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	托管编码	C	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	C	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：托管编码)、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。

11. 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	托管编码	C	6	
2	TJZQDM	证券代码	C	6	
3	TJMRGS	买入股数	N	12, 0	
4	TJMRZJ	买入资金	N	15, 3	
5	TJMC GS	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) 该库为相应托管单元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：托管编码）、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。

12. B 股结算指令库 SJSZL.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZLXWDM	托管编码	C	6	
2	ZLZQDM	证券代码	C	6	
3	ZLGDDM	证券账户	C	10	
4	ZLGFxz	股份性质	C	2	
5	ZLWTSL	委托数量	N	12, 0	
6	ZLYWLB	业务类别	C	2	
7	ZLJSRQ	交收日期	D	8	
8	ZLSFZL	收付种类	C	3	DEL/REC
9	ZLHKFS	划款方式	C	2	FP/AP
10	ZLCJJG	成交价格	N	9, 3	
11	ZLWTJE	委托金额	N	15, 3	
12	ZLDFXW	对方托管编码	C	6	
13	ZLDFDM	对方账户	C	10	
14	ZLDFXZ	对方性质	C	2	
15	ZLWTXH	委托序号	C	8	
16	ZLWTRQ	委托日期	D	8	
17	ZLTXBZ	通信标志	C	1	通信公司用
18	ZLBYBZ	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 代表的托管单元为交付方

‘REC’ 表示 ZLXWDM 代表的托管单元为交收方

(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。

13. 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	托管编码	C	6	
2	ZTZQDM	证券代码	C	6	
3	ZTGDDM	证券账户	C	10	
4	ZTGFXZ	股份性质	C	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	对方托管编码	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	C	40	
19	ZTZYDH	摘要代号	C	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” 表示托管编码无效
- 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” 表示对手方托管编码无效
- 21-22 位等于“57” 表示托管编码等于对手方托管编码
- 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

14. 托管单元信息库 SJSXW.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XWJSXW	托管编码	C	6	
2	XWXWMC	托管单元名称	C	42	
3	XWXWLB	托管单元类别	C	1	
4	XWZTBZ	转托管标志	C	1	
5	XWFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
6	XWBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 该库包含所有托管单元的信息，供券商为投资者办理转托管时使用。

(2) XWXWLB(字段 3: 托管单元类别)用于表明该托管单元是 A 股托管单元或 B 股托管单元。XWXWLB=' A' 表示 A 股托管单元;XWXWLB=' B' 表示 B 股托管单元;XWXWLB=' L' 表示 LOF 跨系统转托管专用的代销人编码;XWXWLB=' X' 表示信用交易专用托管单元。对于同时有 A 股和 B 股业务的托管单元，在本库中有两条记录。

(3) XWZTBZ(字段 4: 转托管标志)为 ' Y' 时，表示该托管单元可以做转托管;XWZTBZ 为 ' N' 时，表示该托管单元不能做转托管。

15. 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	C	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

T、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。

16. 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	托管编码	C	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	
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	C	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: 托管编码)、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 3-12。

(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) JSFSRQ (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 3-13, 其中“Y”表示可用于记账。

业务及费用含义表（表 3-12）

JSYWL B	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 (JSYWL B=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 (JSYWL B=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 3-13）

JSYWL B	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

U、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）（表 3-14）

日期	业务类别 JSYWLB	说明
T 日	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.Dbff)。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结算账户，同时也通过法人资金结算网络传送给境内券商法人。

17. 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	C	2	
2	QSMXZH	明细账号	C	10	
3	QSZQDH	证券代码	C	6	
4	QSXWDM	股份托管编码	C	6	
5	QSJSXW	结算账户	C	6	
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	QSF SRQ	发送日期	D		CCYYMMDD
23	QSBYZ1	备用字段 1	C	12	保留字段
24	QSBYZ2	备用字段 2	C	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 4-1。

(3) QSMXZH (字段 2: 明细帐号) 为会员在结算公司开设的备付金账号, 备付金账号左四位表示资金性质和货币种类(‘B001’表示 A 股人民币备付金账号, ‘B201’表示 B 股港币备付金账号), 右六位是结算账户。

(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 1-1) 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) QSQRQ (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=QSQRQ, 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 4-1)

QSYWLB	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; ‘1C’ 表示公司债的集中竞价交易清算。 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。
DZ	大宗交易平台非担保清算数据 (包括公司债大宗交易、资产证券化及中关村园区业务)	QSZQDH 为证券代号 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证清算数据	QSZQDH 为权证代码 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沽权证清算数据	买入金额表示行权应付资金, 卖出金额表示行权应收资金。

QSYWLB	相应业务含义	说明
W3	以现金方式结算的认购权证清算数据	
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。

18. 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	C	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	资金发生的托管编码	C	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	C	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备付金账号，备付金账号左四位表示资金性质和货币种类(‘B001’表示 A 股人民币备付金账号，

‘B201’表示 B 股港币备付金账号，‘B401’表示人民币开放式基金业务备付金账号)，右六位是结算账户。

(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 4-2 (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: 资金发生的托管编码) 指发生了该笔资金帐的券商托管编码。

(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 1-1, 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 4-2)

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	证券类别/证券代码
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本息金额	证券代码
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
D206	B 股收购资金	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
E004	网下发行认购资金	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

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
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
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/证券代码
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
G206	B 股收购印花税	证券代码
G207	B 股收购监管规费	证券代码
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	证券类别/证券代码
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

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
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	
H029	LOFs/ETFs 发行认购手续费	证券代码
H030	结算费（资产证券化）	证券代号
H031	权证交易经手费	证券类别
H032	权证交易结算费	证券类别
H033	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
H037	ETF 组合证券过户费	证券代码
H045	结算费（公司债）	证券类别/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
H223	B 股收购经收费	证券代码

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
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
I005	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
I008	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
J013	收购资金利息	空格
J014	发行失败退还利息	证券代码
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
J210	B 股收购资金利息	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账户利息	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账户透支罚息	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

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
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。

19. 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	C	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	证件类型	C	1	
14	KWTRQ	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，右端不足部分填充空格。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) KQYWDH (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 5-1。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。

开户委托业务代号含义表 (表 5-1)

KQYWDH	业务描述	关键字段	业务字段	备注
10	股东开户	KWSFZH KWGDXM	除 KWGDDM 外的其余 字段	
11	合并证券账户	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	KWTXDZ 从右到左存 放合并后的证券账 户	
12	注销证券账户	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	无	
13	挂失补办不换号	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	无	
14	挂失补办换新号	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	无	
15	更改股东资料第 一笔委托	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	无	连续两笔委托的 KWGDDM 值必须相 等
16	更改股东资料第 二笔委托	KWGDDM	需更改的业务字段 填入相应值, 否则 填空格	
17	股东资料查询	KWGDDM 或 KWSFZH	无	
18	开通网络服务	KWGDDM KWSFZH KWGDXM	KWTXDZ 前 6 位为初 始密码	
19	休眠账户激活	KWGDDM KWSFZH	无	

(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) KWGDZX (字段 7: 股东性质), 其数据集定义见表 5-2。

开户股东性质定义表 (表 5-2)

KWKHLB	KWGDZX	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 5-6。

(11) KWDHMH (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: 证件类型), ‘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 5-3)。

开户委托错误代号含义表 (表 5-3)

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’

20. 开户回报库 SJSKB.dbf

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

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 KBSFZH KBGDXM KBTXDZ	KBTXDZ 中存放合并后的有效证券账户
12	注销证券账户	KBGDDM KBSFZH KBGDXM	
13	挂失补办不换号	KBGDDM KBSFZH KBGDXM	
14	挂失补办换新号	KBGDDM	新证券账户在 KBGDDM 中

KBYWDH	业务描述	有效字段	备注
		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 KBSFZH KBGDXM	KBTXDZ 前 6 位为初始密码
19	休眠账户激活	KBGDDM KBSFZH KBZYDH	KBZYDH=' ' 表示成功，其余表示失败

(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 5-5。

开户回报摘要代号含义表 (表 5-5)

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	证件类型无效
K39	此项业务暂停使用
K40	其他
K42	国家和地区代码无效

KBZYDH	含义
K43	账户已变名 / 号, 无权变另一项
K44	初始密码错
K51	休眠账户
K52	不合格账户

21. 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	C	6	
2	KTYWDH	业务代号	C	2	
3	KTKHLB	开户类别	C	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	C	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 5-6）

代码	国家和地区中文名称	代码	国家和地区中文名称
ALB	阿尔巴尼亚	ERI	厄立特亚国
ARE	阿拉伯联合酋长国	ESP	西班牙
ARG	阿根廷	ETH	埃塞俄比亚
AUS	澳大利亚	FIN	芬兰
AUT	奥地利	FJI	斐济
BEL	比利时	FRA	法国
BFA	布基纳法索	GBR	英国
BGD	孟加拉	GHA	加纳共和国
BGR	保加利亚	GIB	直布罗陀
BHS	巴哈马	GMB	冈比亚
BIH	波黑	GNB	几内亚比绍
BLZ	伯利兹	GNQ	赤道几内亚共和国
BMU	百慕大	GRC	希腊
BOL	玻利维亚	GTM	危地马拉
BRA	巴西	GUM	关岛
BRB	巴巴多斯	GUY	圭亚那
BRN	文莱	HKG	香港
BTN	不丹	HND	洪都拉斯
BWA	博茨瓦纳	HRV	克罗地亚
CAN	加拿大	HTI	海地共和国
CHE	瑞士	HUN	匈牙利
CHL	智利	IDN	印尼
CHN	中国	IND	印度
CMR	喀麦隆共和国	INU	纽埃
COG	刚果共和国	IRL	爱尔兰
COK	库克岛	IRN	伊朗
COL	哥伦比亚	ISL	冰岛
CPV	佛得角	ITA	意大利
CRI	哥斯达黎加	JAM	牙买加
CTN	台湾	JOR	约旦
CYM	开曼群岛	JPN	日本
CYP	塞浦路斯	KAZ	哈萨克斯坦共和国
CZE	捷克	KEN	肯尼亚共和国
DEU	德国	KHM	柬埔寨
DNK	丹麦	KIR	基里巴斯共和国
DOM	多米尼加	KNA	圣基茨和尼维斯联邦
ECU	厄瓜多尔	KOR	韩国
EGY	埃及	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

代码	国家和地区中文名称
RUS	俄罗斯联邦
SAU	沙特阿拉伯
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
ZMB	赞比亚
ZWE	津巴布韦

六、 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。

22. 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	结算账户	C	6	必填项
2	BSYWLB	业务类别	C	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	C	8	必填项, 委托流水号
5	BSZQDM	证券代码	C	6	
6	BSGDDM	证券账户	C	10	
7	BSXWDM	托管编码	C	6	
8	BSYWSJ	业务数据	C	30	
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	C	1	
14	BSBZ2	标志 2	C	1	
15	BSDFXW	对方托管编码	C	6	
16	BSDFGD	对方证券账户	C	10	
17	BSDFXZ	对方股份性质	C	2	保留
18	BSNR1	备注内容 1	C	60	
19	BSNR2	备注内容 2	C	120	保留
20	BSRQ1	日期 1	N	8, 0	
21	BSRQ2	日期 2	N	8, 0	
22	BSWTRQ	委托日期	D		必填项
23	BSWTSJ	委托写入时间	C	8	必填项, HHMMSSXX
24	BSCLBZ	处理标志	C	1	必填项

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
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 6-1。

(2) BSZJJS（字段 1：结算账户），托管编码（字段 7：BSXWDM）所属的结算账户，用于委托数据的安全性检查，限制用户只能发送属于自己结算账户下的数据。

(3) BSYWLB（字段 2：业务类别），委托业务类别含义详见表 6-2。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 6-1。

(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，唯一标识同一托管编码下的委托。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。

(10) BSBZ2（字段 14：标志 2），不同业务类别对应不同用法。

(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。

(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。

(13) BSWTRQ（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 6-4。

(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 6-1）

BSYWLB	BSWTLX	业务字段的填报说明
7A	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSBZ1, BSBZ2, BSNR1, BSRQ1, BSRQ2 BSWTSL 为申请冻结股数。BSWTSL>0, 则冻结指定股数; BSWTSL=0, 则冻结所有股数。 BSBZ1 为联动深度, 【 1: 原股冻结 2: 原股+红股冻结 3: 原股+红股+配股（权证及认购后股份）冻结 】。 BSBZ2 为执行机关类型, 【A: 法院 B: 证监会 C: 其他】。 BSNR1 为冻结执行机关名称。 BSRQ1 为冻结起始日期。BSRQ1=0, 表示冻结起始日期为当日。 BSRQ2 为冻结截止日期。BSRQ2<>0, 格式为 YYYYMMDD, 用于冻结截止日期; BSRQ2=0, 表示无限期冻结。
		无
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
7B	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSYWSJ, BSWTSL BSWTSL 为申请解冻股数。BSWTSL>0, 则解冻指定股数; BSWTSL=0, 则解冻所有股数。 BSYWSJ 中为原冻结序号, 10 位字符, 左对齐右补空格
		无
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
7C	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSYWSJ, BSRQ2 BSYWSJ 中为原冻结序号, 10 位字符, 左对齐右补空格。 BSRQ2 为续冻截止日期。BSRQ2<>0, 格式为 YYYYMMDD, 用于续冻截止日期; BSRQ2=0, 表示续冻为无限期冻结。
		无
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
7D	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSBZ1, BSBZ2, BSNR1, BSRQ2 BSWTSL 为申请轮候冻结股数。BSWTSL>0, 则轮候冻结指定股数; BSWTSL=0, 则轮候冻结所有已冻结的股数。 BSBZ1 为联动深度, 【 1: 原股冻结; 2: 原股+红股冻结; 3: 原股+红股+配股（权证及认购后股份）冻结。 】 BSBZ2 为执行机关类型, 【A: 法院 B: 证监会 C: 其他】 BSNR1 为冻结执行机关名称。 BSRQ2 为轮候冻结期限。BSRQ2>0, 单位为月, 最大轮候冻结期限为 99 个月。
		无
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。

7E	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSYWSJ
		BSYWSJ 中为原轮候序号, 10 位字符, 左对齐右补空格
	C/撤单	无
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
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单元进行申报, BSGDDM 为其普通证券账户, BSDFGD 为其信用证券账户, BSDFXW 为信用交易专用托管单元。 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托管单元进行申报, 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单元。
	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单元进行申报, BSGDDM 为其自营证券账户, BSDFGD 为其融券专用证券账户, BSDFXW 为其信用交易专用托管单元。 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托管单元进行申报, 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单元。
	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托管单元申报, 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托管单元申报, 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。
S1	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSDFGD, BSYWSJ, BSRQ1。
		本类指令可以在 B 股交易后修改一类指令的股东代码。 BSZQDM 填写交易的证券代码; BSXWDM 填写交易单元代码; BSGDDM 填写成交的错误股东代码, BSDFGD 填写正确的股东代码; BSWTSL 填写成交股数, 买入为正数, 卖出为负数; BSYWSJ 左 8 位填写成交号码; BSRQ1 填写交易日期。(只允许修改交易日期为 T-1 或 T-2 日的一类指令)。
	C/撤单	无。
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
S2	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSWTZJ, BSDFXW, BSRQ1。
		BSXWDM、BSGDDM 填写报盘方的托管单元编码和股东代码, BSDFXW 填写

		交收对手方的托管单元编码；BSWTSL 填写需交收的证券数量，正数表示收券，负数表示付券；若需要付款，需要将资金金额填入 BSWTZJ，正数表示收款，负数表示付款；BSRQ1 填写交收日期。
	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单元，BSDFGD 为补登记后深圳证券账户。
	C/撤单	无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
ZC	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSYWSJ, BSNR1。 BSZQDM 为债券代码，BSGDDM 为投资者证券账户，BSXWDM 为债券的转出托管单元，BSWTSL 为拟跨市场转出的债券数量（单位：张），BSYWSJ 为转入交易场所在中央国债登记结算公司的托管账号（左对齐，右补空格），BSNR1 为申请人在转入交易场所债券托管账号或国债柜台托管账号或证券账号（左对齐，右补空格）。
	C/撤单	无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
ZT	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL, BSDFXW。 BSXWDM 为原转托管的转出托管单元，BSWTSL 为原转托管的转出股数，BSDFXW 为原转托管的转入托管单元。对于有效的“ZT”指令，系统在当日日终将股份从 BSDFXW 调回 BSXWDM。
	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 6-2）

BSYWL	委托业务含义	报盘方式
7A	冻结	单边报盘
7B	冻结解冻	单边报盘
7C	冻结续冻	单边报盘
7D	轮候冻结	单边报盘
7E	轮候冻结解除	单边报盘
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)	单边报盘，由划出方进行单边报盘

BSYWLB	委托业务含义	报盘方式
7A	冻结	单边报盘
7B	冻结解冻	单边报盘
7C	冻结续冻	单边报盘
7D	轮候冻结	单边报盘
7E	轮候冻结解除	单边报盘
	融券专用证券账户之间的非交易过户业务)	
S1	B 股一类指令修改指令	单边报盘
S2	B 股二类指令	双向报盘
X2	沪市账户挂账股份补登记	单边报盘
ZC	债券跨市场转出	单边报盘
ZT	转托管出错调整 (由原转托管发起方发起)	单边报盘

处理标志错误含义表 (表 6-3)

错误代码	错误描述
A	结算账户错误
B	委托类型错误
C	委托序号格式错误
D	委托数量格式错误
E	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
H	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

23. 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	C	10	数字字符串
2	QRZJJS	结算账户	C	6	
3	QRYWLB	业务类别	C	2	
4	QRWTLX	委托类型	C	1	S=申报, C=撤单
5	QRWTXH	委托序号	C	8	委托流水号
6	QRZQDM	证券代码	C	6	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
7	QRGDDM	证券账户	C	10	
8	QRXWDM	托管编码	C	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	C	1	
16	QRDFXW	对方托管编码	C	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	C	8	HHMMSSXX
25	QRCWDH	错误代号	C	3	空表示申报成功， 否则返回错误代码
26	QRQSBZ	备用标志	C	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) QRYWLB(字段 3: 业务类别)，'M2' 表示二类指令的预配对结果，每个 B 股工作日中午十二点后，结算公司对该工作日上午报送的二类指令进行预配对处理，配对结果通过 M2 业务回报。

其它业务请参见非交易报送库中的业务类别字段的说明。

(3) QRYWSJ(字段 9: 业务数据)，当 QRYWLB 为 'S2' 或 'M2' 时，QRYWSJ 表示二类指令错误或配对失败原因，具体定义为：

- 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” 表示托管编码无效;
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” 表示对手方托管编码无效;
21-22 位等于“57” 表示托管编码等于对手方托管编码;
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。

(4) 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 6-4。

(5) 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 6-4)

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
B03	指令未配对
B04	无效申报
D01	证券代码无效
D05	转入托管编码无效
D06	此证券不可转托管
D07	转出托管单元不允许转托管
D08	转入托管单元不允许转托管
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	此托管单元不可质押
D33	托管编码无效

错误代码	错误代码含义
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
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
D68	担保券应在信用和普通席位间划拨
D69	担保券应在信用和普通账户间划拨
D70	券源应在信用和普通托管单元间划拨
D71	现券还券应在券源与信用户间进行
E01	证券账户无效
E02	重复申购
E03	申购股数无效
E04	无市值
E05	托管编码无效
E07	竞价申购失败
E08	申购资金不足
E09	认购不确认
E49	委托类型无效
E50	业务类别无效
E51	托管编码无效
E52	证券代码无效
E53	证券账户无效

错误代码	错误代码含义
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	托管单元不从属于结算账户
E59	托管单元被禁买或禁卖
E60	证券账户被禁买或禁卖
E61	对方托管编码无效
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	对方托管单元被禁买或禁卖
E66	对方证券账户被禁买或禁卖
E67	处理序号无效
E68	撤单记录不存在
E69	成交日期或交收日期无效
E70	成交号码无效
E71	目标记录不存在
K32	两账户身份证/注册号码不一致
K35	序号重复, 委托无效
K41	有司法冻结股份