
固定收益证券综合电子平台试行交易 登记结算技术接口介绍

中国结算上海分公司

2007年7月



1 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

目录

- 总述
- 交易商之间的现券交易
- 隔夜回购/购回
- 债券质押出入库
- 卖空扣款/还款、卖空违约金
- 待交收
- 预清算



一、总述

- 固定收益证券综合电子平台相关的登记结算数据通过现有结算参与人数据文件发送，相应的结算数据和对账数据的发送原则不变；
- 结算明细文件新增交易商之间的交易、隔夜回购/购回、债券质押出入库、证券卖空扣款/还款、证券卖空违约金结算数据内容；
- 固定收益证券综合电子平台各类业务的证券变动通过ZQBD文件体现；日终后登记余额通过ZQYE文件体现；
- 债券利息、标准券折算率通过现有的证券结算信息(zqjsxx)文件体现；标准券余额/质押物明细通过现有的证券其他数量对账(qts1)文件体现。



二、交易商之间的现券交易

- 结算数据通过结算明细（jsmx）文件和资金汇总（zjhz）文件发送：
 - 交易方式=“101”
 - 业务类型=“601”
 - 清算标志=“00A”
 - 成交编号=结算系统受理编号
 - 申请编号=上证所成交回报中的“成交编号”
- 证券变动数据通过证券变动（zqbd）文件发送：
 - 变动类型=“00A”



三、隔夜回购/购回

- 结算数据通过结算明细（jsmx）文件和资金汇总（zjhz）文件发送：
 - 交易方式=“101”
 - 业务类型=“602”/“603”
 - 清算标志=“00B” /“00C”
 - 成交编号=结算系统受理编号
 - 申请编号=上证所成交回报中的“成交编号”
 - 借券方买卖标志=“B”，贷券方买卖标志=“S”，回购与购回一致
- 现券变动数据通过证券变动（zqbd）文件发送：
 - 变动类型=“00A”



四、债券质押出入库

- 结算数据通过结算明细（jsmx）文件发送：
 - 交易方式=“101”
 - 成交编号=结算系统受理编号
 - 申请编号=上证所成交回报中的“成交编号”
 - 其他同撮合系统债券出入库结算数据
- 现券变动数据通过证券变动（zqbd）文件发送：
 - 变动类型=“00M”



五、卖空扣款/还款、卖空违约金

- 卖空扣款/还款、卖空违约金结算数据通过结算明细（jsmx）文件和资金汇总（zjhz）文件发送：
 - 交易方式=“003”
 - 业务类型=“833”（卖空扣款/还款）、“817”（卖空违约金）
 - 清算标志=“21A”（卖空扣款）、“21B”（卖空还款）、“102”（卖空违约金）



六、待交收

- 待交收数据在结算明细（jsmx）文件体现，与其他证券待交收一致。判断条件为：
交易商之间的现券交易、隔夜回购/购回数据中，交收数量不等于成交数量、结果代码为“8001”的记录
- 发生待交收的证券，当日ZQYE文件中无此部分证券的持有



七、预清算

- 我司提供的最后一批（15:00后）预清算统计数据中，将包含固定收益证券综合电子平台交易商之间现券交易、隔夜回购、隔夜购回的预清算金额。

