

T+1DVP 业务及数据接口常见问题及解答

T+1DVP 业务部分

1、什么是 T+1DVP 结算制度？

“T+1DVP 结算制度”由结算公司组织的，以结算参与人为交收对手、交收期为 T+1 日的证券、资金净额对付结算制度。结算公司与结算参与人进行证券资金交收过程中，当且仅当资金交付时给付证券、证券交付时给付资金；对于交收违约按业务规则进行处置。

2、证券资金分级结算的内容是什么？

结算公司负责办理结算公司与结算参与人之间的证券和资金结算；结算参与人负责办理结算参与人与客户之间的证券和资金结算。

3、T+1DVP 结算制度的适用范围是哪些？

T+1DVP 结算制度的适用范围是已纳入净额清算、担保交收的业务品种，具体包括：

二级市场交易品种，包括：A 股、债券（包括国债、企业债券、可转债）、封闭式基金、ETF、权证等。

担保交收的发行类业务：配股、增发、市值配售、国债场内分销等。

实施 DVP 制度后，目前 ETF、权证和买断式回购初次结算的待交收制度不再实行。

4、参与人会不会因交易对手违约而得不到资金或证券？

对于纳入净额结算、担保交收的证券品种，结算公司作为所有结算参与人的共同交收对手，对履约参与人无条件履行证券和资金的交收责任后，再对违约参与人进行交收违约处理，因此，履约参与人不会因交易对手违约而遭受任何损失。

5、DVP 实施后资金清算净额有何变化？

目前，资金清算净额分为一级市场清算净额和二级市场清算净额。DVP 实施

后，一级市场新股资金申购业务的资金清算维持现有方式不变，现在的二级市场资金清算净额将变成交易清算净额、应收权益资金和新股退新资金三项。

6、DVP 实施后证券净额如何计算？

以结算参与人为单位，对所有纳入净额结算的证券品种的成交数据，按各证券账户轧差计算各证券品种净应收或净应付数量，分别汇总各证券品种的应收和应付数量，形成参与者应收、应付证券净额。

7、DVP 实施后债券结算全价有何变化？

DVP 实施后，实行净价交易的国债现券和买断式回购业务，其按全价结算时的应计利息由目前的交易日利息调整为交收日的利息。

8、结算参与者 T 日交易应收款何时可以从备付金账户中划出？

结算参与者完成 T 日交易的交收后方可将其应收款划出，由于交收时点为 T+1 日 16:00，因此实际划出时间为 T+2 日上午 9:00 以后。

9、权益资金和新股退新资金何时可以从备付金账户中划出？

权益资金于权益发放日我司 9:00 之前完成记增备付金账户，新股退新资金于退新日（新股申购 T+4 日）我司 9:00 点之前完成记增备付金账户，上述帐务处理完成后，相关备付金账户在满足当日交收的前提下，参与者可根据账户可划款金额情况将资金划出。

10、对 T 日新股申购资金结算公司是否控制划出？

结算公司在 T+1 日日间控制参与者 T 日已到位新股申购资金的划出，参与者备付金账户可划款金额计算中已扣减 T 日新股申购资金。

11、参与者应补资金包括哪几类？

应补资金为参与者于 T+1 日交收截止时点前需补入备付金账户的资金，上述金额除担保交收应付款外，还包括新股申购应补资金及最低备付不足应弥补资金。

12、 **可划款金额、应补资金如何查询？**

T+0 日清算交收完成后，参与人可根据结算公司发送的资金余额对帐文件查询可划款金额及应补资金。

T+1 日日间，可划款金额和应补资金的实时查询途径略有不同，结算参与人可通过 PROP 券商端和电话语音信箱查询可划款金额，但只能通过 PROP 券商端查询应补资金情况。需提请参与人注意的是，电话语音信箱中提示的“资金余额”即“可划款金额”。

13、 **最低备付的计算公式和调整方式是否有变化？**

最低结算备付金的来源、用途、管理、最低限额的计算与调整等仍依据《结算备付金管理办法》有关规定执行，最低结算备付金缴存比例下调至 15 %。

14、 **由于第三方原因造成的交收透支，是否可以豁免参与人承担的相应责任？**

结算公司将严格执行结算业务规则的规定，任何形式的透支责任都不能得到豁免，如因第三方原因导致参与人交收透支，参与人事后可向有关方追偿相关损失。

15、 **价差担保品账户如何计息？**

价差担保品账户的适用利率、结息方式与备付金账户相同。

16、 **在何种情况下会发生关联交收？**

对已完成备付金账户分户核算的参与人，如在交收日其客户结算备付金账户不满足可交收资金余额 T+1 日应付交收款条件、且有自营结算备付金账户可供关联交收的，在该参与人自营备付金账户已完成自营业务交收的前提下，结算公司进行关联交收处理，将关联交收金额由自营结算备付金账户划拨至该结算参与人的客户结算备付金，用于客户结算备付金帐户的资金交收。

17、 **实施 T+1DVP 制度后，T 日有证券交易的账户，在 T+1 日可以撤消指定交**

易吗？

实施 T+1DVP 制度后，结算参与人应该限制 T 日有证券交易的证券账户在 T 日和 T+1 日都不能撤消指定交易，待投资者和结算参与人之间的交收以及结算参与人和登记结算公司之间的交收都完成后，从 T+2 日起，投资者可以撤消指定交易。

18、 实施 T+1DVP 制度后，通过 PROP 办理的预受要约、司法冻结、自营证券质押等非交易业务，是否也改为 T+1 处理？

实施 T+1DVP 制度后，通过 PROP 办理的预受要约、司法冻结、自营证券质押等非交易业务仍然是 T 日申报，T 日日终处理。

19、 当天买入的证券是否当天可以申报办理自营证券质押、司法冻结或预受要约业务？

当天买入的证券因为还没交收，买入方投资者并没有取得这笔证券，因此在买入的当天不能办理质押。结算参与人如果希望将买入的证券立即质押，最早可于买入证券次一工作日的日间通过 PROP 申报质押登记，申报日的日终，如果该笔买入证券正常交收，则质押登记生效。同理，当日买入的证券最早可于次一工作日被司法冻结或申报预受要约。

20、 实施 T+1DVP 制度后，可用于 PROP 申报质押登记、司法冻结、预受要约等的证券数量有何限制？

实施 T+1DVP 制度后，结算参与人通过 PROP 申报质押登记、司法冻结、要约收购预受股份临时保管的最大数量应满足以下公式：

$$T \text{ 日日终可质押(冻结或临时保管)的最大数量} = T \text{ 日完成 } T-1 \text{ 日交易交收、质押券入库处理后的持有} - T \text{ 日净卖出} - \text{已冻结数量}$$

21、 实施 T+1DVP 制度后，自营证券质押与目前有何不同？

参与人与银行 T 日通过 PROP 申报自营证券质押业务，

(1) 相关费用的清算时间目前是 T+1 日，实施 T+1DVP 制度后调整为 T 日；

(2) 申报当天如果是兑息登记日，目前质押的债券不包含兑息部分，

实施 T+1DVP 制度后包含兑息；

(3) 目前买入证券当日即可申报质押，实施 T+1DVP 制度后 T 日买入证券最早可于 T+1 日申报质押过户。

22、 T+1DVP 中的证券交收锁定是如何处理的？

对于净卖出证券的投资者，交易一经达成，其净卖出的证券就进入交收程序，当日日终在卖出方证券账户内被交收锁定，被交收锁定的证券只能用于证券交收，不得申报交易卖出，不能被司法冻结、非交易过户、申报要约或质押。

23、 实施 T+1DVP 制度后，挂失转户与目前有何不同？

T 日参与人通过 PROP 申报账户挂失转户，目前是 T 日老账户销户，T+1 日日终过户到新账户，过户证券 T+2 日起可交易；实施 T+1DVP 制度后改为 T 日老账户销户，T 日日终过户到新账户，过户证券 T+1 日起可交易。

24、 实施 T+1DVP 制度后，通过 PROP 查询投资者账户持有记录中，查询到的是可用余额吗？

实施 T+1DVP 制度后，通过 PROP 查询投资者账户持有记录中将会有三个持有数量：日终持有数量、其中的冻结数量、其中的交收锁定数量。

“日终持有数量”是完成日终交收后的持有，包括该日日间净卖出的证券数量，但不包括该日日间净买入的证券数量；

“其中的冻结数量”是“日终持有数量”中被司法冻结、质押、临时保管、预受要约等的数量之和；

“其中的交收锁定数量”是“日终持有数量”中于该日日间净卖出的证券数量，该部分证券已进入交收程序，不能被司法冻结、非交易过户、申报要约或质押。

25、 实施 T+1DVP 制度后，通过 PROP 查询的持有变动证券与目前有何不同？

目前证券按交易结果逐笔交收，交易过户记录也是逐笔列示，一个账户同一天对一只证券有多笔买卖交易的，交易过户记录也是多笔。实施 T+1DVP 制度后，以证券账户为单位对同一天达成的同一只证券所有买卖交易进行轧差，并以轧差后的净额进行证券交收，因此交易过户记录也以净额列示，一个账户

同一天一只证券最多只有一笔净增加或净减少的交易过户记录。另外，非交易过户记录仍为逐笔列示。

26、 实施 T+1DVP 制度后，在权益登记日当天买入股份是否享有权益？

目前，投资者在登记日当日买入证券，即享有该证券产生的权益；当日卖出证券，不享有该证券产生的权益。实行 T+1DVP 后，投资者在登记日前一交易日买入证券并完成交收，可享有该证券产生的权益，登记日买入证券，不享有该证券产生的权益；投资者在登记日前一交易日卖出证券，不享有该证券产生的权益，登记日将持有的证券卖出，仍然享有该证券产生的权益。

27、 实施 T+1DVP 制度后，权证发行人办理权证创设和注销业务时，有哪些变化？

目前权证创设注销都是非实时的，实施 T+1DVP 制度后，权证创设的流程和时点与目前相同，T 日买入标的证券，最早可于 T+2 日创设权证，T+3 日当天可卖出新创设的权证。权证注销与目前有所不同，创设人权证创设专户 T 日买入的权证当日不能被注销，最早可于 T+1 日注销。

28、 已经卖出的证券在完成交收之前，所有权属于买方还是属于卖方？

已经卖出的证券在完成交收之前，存放于卖出方投资者证券账户，卖出方拥有所有权，买入方不拥有所有权。

29、 实施 T+1DVP 制度后，股东名册与目前有何不同？

登记日买入证券，其持有记录不出现在当日闭市后产生的股东名册中；投资者在登记日将持有的证券卖出，其持有记录仍出现在当日闭市后产生的股东名册中。投资者在登记日前一交易日买入证券并完成交收，其持有记录在登记日闭市后可出现在股东名册中。

30、 在何种情况下，参与人需要申报证券划拨指令？

证券划拨指令是参与人向结算公司申报，由结算公司代为将相关证券从参与人证券交收账户划拨至投资者证券账户或证券处置账户，以及从证券处置账户划拨到证券交收账户的指令。在以下三种情况下，参与人须向结算公

司发送证券划拨指令。

1) 从证券交收账户划拨至证券处置账户：T+1 日参与人在完成资金交收的前提下，可以发送证券划拨指令，向结算公司申请代为将违约投资者的净应收证券从参与者证券交收账户划拨至其证券处置账户。

2) 从证券处置账户划拨至证券交收账户：参与者可以发送证券划拨指令，向结算公司申请代为将证券处置账户中的证券划拨至原买入的投资者证券账户。

3) 确定拟处置证券后的剩余待处分证券的返还：T+2 日，若参与者继续透支，结算系统按一定的规则从 T+1 日的待处分证券中确定拟处置证券后，将剩余的 T+1 日待处分证券代为划拨到参与者证券交收账户。结算参与者需发送证券划拨指令，提请结算公司将参与者证券交收账户的证券代为划回原买入的投资者证券账户或参与者证券处置账户。

31、 在何种情况下，参与者无须申报证券划拨指令？

以下情况，参与者无须发送证券划拨指令，结算公司根据成交情况代为将相关证券从参与者证券交收账户划拨至投资者证券账户。

1) 净应付证券划付：T+1 日交收时点，结算公司根据 T 日证券交易清算结果，无条件将净应付证券从投资者证券账户代为划拨至参与者证券交收账户。

2) 净应收证券划付：对参与者已完成交收的证券（包括 T+1 日完成交收的证券，和 T+2 日补足透支后交收的证券），如无因投资者违约而需处置客户应收证券的情况（必须申报证券划拨指令），结算公司自动根据 T 日证券清算结果，将全部净应收证券从参与者证券交收账户代为划拨至投资者证券账户。

32、 参与者申报证券划拨指令的注意事项是什么？

当转入账户为投资者证券账户时，参与者指定的过入证券账户必须为原应收（原待处分证券）证券账户，过入的券种应与原应收证券券种相符，且过入数量不高于原应收数量及自身权益之和。

划回证券总量不超过参与者证券交收账户或参与者证券处置账户所持证券数量。

33、 资金交收违约的后果是怎样的？

T+1 日交收后，参与人结算备付金账户可交收资金余额小于 0 的，则资金交收违约。其后果为：

- 1) T+1 日结算公司按参与人的证券待处分指令办理证券交收，或暂不交付参与人所有的净应收证券，未完成交收的证券 T+2 日无法卖出。
- 2) T+1 日因买入国债未能正常交收，可能出现新增欠库扣款、新回购业务入库和出库失败及老回购业务被限制撤销回购登记。
- 3) T+2 日，结算参与人仍未补足透支的，结算公司自 T+3 日处置相关待处分证券。
- 4) 向违约参与人计收违约金和垫付利息。
- 5) 其他处理措施：商交易所暂停交易及取消结算参与人资格。

34、 参与人如何应对资金交收违约？

- 1) 事先提交符合要求的自营证券作为履约交收担保品。
- 2) 交收透支当日指定足额合资格待处分证券。参与人交收日如预期无法完成资金交收，可向结算公司申报“证券待处分指令”文件，以完成其上一日交易的全部或部分交收。

35、 交收透支当日提交自营证券担保品，是否能用于当日透支的担保交收？

自营证券通过非交易过户方式转入证券担保品账户后才能作为交收担保品使用，按照交易交收优先原则，非交易过户在交易交收完成后处理，因此，透支当日提交的自营证券担保品将无法为当日的交收透支提供担保。只有透支上一工作日日终证券担保品账户中已有证券才能用于担保。

36、 能否提交客户证券作为交收担保品？

按目前相关规定，不能事先提交客户证券作为交收担保品。

37、 自营证券作为交收担保品的价值如何核算？

证券交收担保品价值按自营证券用于担保交收的上一交易日该证券的收盘价×数量（扣减冻结部分）×折扣比例进行核算，目前的折扣比例为 60

%。

38、待处分证券的指定范围是什么？

待处分证券的指定范围是参与人当日应收证券和回购到期证券账户内或席位上的质押券。

特别提示：不能将T日买入并已用于回购的国债提交为待处分证券（此类指令作为无效指令），否则无效的提交将形成因未足额指定而导致全部买入不交收的结果，并可能造成新增回购欠库和部分出库失败。

39、申报证券待处分指令注意事项是什么？

除确保待处分证券的指定范围正确以外，参与人还须注意以下事项：

- 1) 所申报证券账户须指定交易在该参与人的席位上。
- 2) 所申报回购登记帐户对应的债券主席位须属该参与人。
- 3) 如果指定的待处分证券是债券质押券，必须加以注明。
- 4) 如申报质押券为回购登记帐户内的持有，该证券帐户内某一品种可用质押券数量(可用质押券数量=持有数量—冻结数量—T日交易交收锁定数量)必须大于或等于本次指定数量，同时不能因本次指定而导致其对应的债券主席位欠库。
- 5) 如所申报质押券已入质押库，该证券账户已入库的某一品种可用质押券数量必须大于或等于本次指定数量，同时不能因本次指定而导致该证券帐户欠库。
- 6) 如所申报应收证券中有债券，T日买入并已用于回购部分不得提交；其他应收证券的指定数量不能超过其证券账户中各对应代码的应收数量。
- 7) 如同一参与人当日多次上传证券待处分数据文件，结算系统对符合标准的申报文件以累加的方式进行处理。

40、如何判断指定的待处分证券是否足值？

待处分证券价值与可用证券交收担保品价值之和大于T+1日新增透支金额，则为待处分证券指定足值，否则，待处分证券指定不足值。

待处分证券价值按其类别分别核算：交易应收证券的价值按交易日收盘价核算、发行类应收证券的价值按业务属性（配股按配股价、市值配售和分

销国债按发行价)核算,质押券的价值按T日适用的标准券折算率核算。

可用证券交收担保品价值=全部证券交收担保品价值—已用于担保的证券交收担保品价值。

41、 如何确定拟处置证券？

首先在结算系统的专用清偿证券账户中的待处分证券范围内确定拟处置证券,对不同类别的待处分证券,本公司确定拟处置证券的顺序如下:现金类权益(股票红利权益、债券兑付权益、债券兑息权益)、一般证券(含国债分销)、ST 证券、权证、发行类证券(包括市值配售、配股、老股东优先配售、增发等所得证券)。同一顺序的待处分证券,按各券种的价值权重分别确定处置数量。

如果全部待处分证券均被确定为拟处置证券后,其价值仍低于拟处置证券的目标价值,且上日已动用自营证券交收担保品的,本公司将相关证券交收担保品确定为拟处置证券,直至满足目标价值要求。

42、 回购质押券管理的基本原则和管理措施是什么？

基本原则:参与人回购质押券须能足额担保未到期和已到期但尚未履约的回购应付款。

管理措施:回购登记撤销和出库以质押物充足为前提。回购融资总额超过标准券总量时,对将超出部分进行欠库扣款处理,并按欠库扣款金额对参与人并计收违约金。另外,对于老回购未到期融资回购总额大于老回购的融资规模上限的,结合欠库扣款处理情况进行超规模扣款处理。

43、 DVP 实施后欠库核算的处理有何变化？

T+1DVP 实施后,欠库核算将由目前的T日核算变成T日核算及T+1日的两次核算,T日进行的首次欠库核算并入清算,T+1日根据证券的最终交收结果再次进行欠库核算,如有新增欠库当日直接通过资金交收账户扣收。

44、 如何进行老回购的欠库核算？

T日核算:根据T日回购登记账户实际持有的质押券数量和T日国债交

易情况，初次核算主席位标准券总量。若 T 日未到期融资回购规模大于主席位上标准券总量，对超出部分进行欠库处理，并将欠库扣款金额并入当日清算。另外，若 T 日未到期融资回购规模大于老回购的融资规模上限，需结合欠库扣款处理情况进行超规模扣款处理。

T+1 日的核算：按照完成交收后回购登记账户实际持有的质押券数量核算主席位最终标准券总量。根据 T 日未到期融资回购规模、最终标准券总量及老回购的融资规模上限等因素，确定是否有新增欠库扣款，若有则当日直接通过结算备付金账户扣收。

45、 如何进行新回购的欠库核算？

T 日欠库核算：根据质押库内的证券账户实际持有质押券数量（处理完 T 日申报的存量券入库和出库且卖出部分出库）与 T 日买入并申报入库情况，初步核算证券账户标准券总量，若 T 日未到期融资回购总量大于标准券总量，超过部分将被欠库扣款，欠库扣款金额并入当日清算。

T+1 日欠库核算：按照完成交收后质押库内的证券账户实际持有，确定证券账户最终标准券总量。根据证券账户 T 日未到期融资回购数量及最终标准券总量，确定是否有新增欠库扣款，若有则当日直接通过结算备付金账户扣收。

46、 如何进行回购质押券出入库管理？

DVP 制度实施后，质押券的出入库处理将由现在的 T 日申报、T 日处理变成 T 日申报、T 日和 T+1 日两次处理。

T 日申报、T 日处理的业务包括：T 日申报存量券的入库、T 日申报出库且卖出部分。上述出、入库均成功。

T 日申报、T+1 日处理的业务包括：T 日买入并申报入库、T 日申报出库而未卖出部分。其中，T 买入并申报入库是否成功，取决于该部分证券是否完成交收。T 日申报出库而未卖出部分的出库是否成功，取决于出库后质物是否充足。

47、 DVP 实施后结算系统处理质押券出库的顺序是怎样的？

DVP 实施后，结算系统处理质押券出库的处理顺利是：先处理前日申报

且未卖出部分的出库，再处理兑付款自动出库，最后处理当日申报出库且卖出的出库。

除当日申报出库且当天卖出的以外，其余必须在出库成功的次日方可卖出。

48、 结算系统如何处理在库兑付款？

在库的兑付款出库于兑付清算日始由结算系统自动处理，每日交收完成后，兑付款在剩余质押券足额担保未到期回购的前提下出库成功，并入当日清算，直至兑付款全部出库。

49、 DVP 制度实施后如何处理证券交收违约？

T+1 日交收时点，如某结算参与人名下某净卖出证券账户中某证券品种数量（扣减冻结部分）小于 T 日清算时的该帐户该证券品种应付数量，该参与人发生证券交收违约（证券卖空）。

对于可在交收日平仓的证券卖空，结算系统当日完成“平仓处理”。

对于其他证券卖空，若参与人 T+2 日未自行补足卖空证券，结算系统自 T+3 开始进行补购平仓。

结算公司按卖空金额对卖空计收违约金。

50、 如何进行交收价差担保品管理？

交收价差担保品是由结算参与人划入的、用于担保结算公司处置待处分证券的价差损失的款项。结算参与人可以主动从银行账户或结算备付金账户划入，多余部分划出只能划到参与人备付金帐户。

初始最低限额为 200 万元；本公司将于每月前三个工作日根据下列公式计算并调整，并于计算当日通知结算参与人新限额及生效日：

交收价差担保品最低限额 = 每月应付交收款累计额 / 每月应付交收款的天数 × 交收价差担保品缴存比例。

其中，“每月应付交收款累计额”是指当某月有若干个交收日发生交收应付时，将这些交收日的应付款累加计算后的金额。某交收日该参与人上日交易清算净额与当日交收时的卖空返款、欠库扣返款、买空处置款等轧差后的净额如为应付结算系统款项，该净额即为当日应付交收款。

结算参与人交收价差担保品账户内资金余额不足时，本公司在完成一、二级市场资金交收后，从其对应的结算备付金账户（如分户账户，需区分客户、自营）中扣收，直至交收价差担保品足额为止。从备付金账户中扣款的上限为该备付金账户满足当日交收及各项货银对付风险管理相关账务处理后，结算备付金账户中可交收金额（含最低结算备付金）。

数据接口部分

1. 实施 T+1 货银对付制度后，数据接口方面涉及到哪些文件的改动？

实施 T+1 货银对付制度后，所有数据仅涉及新版登记结算数据文件的修改，且数据接口文件的格式没有任何变化，仅是数据内容有相应的修改或新增。

2. 证券余额文件中的余额 1 字段包括当日交易的数量吗？

在证券余额文件中的余额 1 不包括当日交易未交收的证券数量，当日成交证券净额轧差数量在其他数量文件中发送。

3. 证券账户下一日可交易证券数量该如何计算？

$T+1$ 日可交易证券数量 = T 日证券余额文件中余额 1 - T 日证券余额文件中余额 2（证券冻结部分的数量） + T 日其他数量文件中的数据类型为‘010’记录中的 SL1（ T 日成交证券净额轧差数量）。

如证券账户被账户冻结（可通过账户托管文件确定），则可交易证券数量应为 0。如果结算参与人有自身的风险控制等其他需要，上述计算公式可能需要作相应的调整。

4. 证券变动文件中的变动数量的具体含义是什么？在该文件中是否保留交易明细？

证券变动文件中的变动数量分为交易与非交易两类。对于交易类，为在 $T-1$ 日交易成交并在 T 日完成实际交收的净额轧差数量，但不包括 T 日成交未交收的数量，“变动类型”均为‘00A’。需要说明的是，对于当日交收的所有证券，在变动文件中只发送一条数据，体现当日某证券的变更登记数量，因此在该文件中不再保留 $T-1$ 日的交易明细信息，该信息在结算明细文件中体现。对于非交易类，证券变动仍然为逐笔明细。

5. 在资金汇总文件中增加了一种对结算明细文件的资金汇总方式,该汇总记录对参与人有何意义?

在资金汇总文件中增加了按照清算编号和资金类别进行汇总的方式,只汇总当日清算下一工作日交收的清算明细记录。该汇总记录的记录类型为‘900’,资金类别包括:交易交收、权益资金、新股申购和新股退新四类。该汇总记录的意义在于,参与人可以据此了解某清算编号在当日清算下日交收的资金情况,便与进行资金划拨准备。当然参与人需要按照清算编号和备付金账户的对应关系,对同一备付金账户下的多个清算编号的汇总数据进行累加。此外,在资金余额文件中也通过 ZJ1 字段发送下一工作日备付金账户应补资金数据。

6. 实施 T+1 货银对付制度后,结算明细文件主要有哪些变化?

实施 T+1 货银对付制度后,仍然在 T 日发送清算明细数据(记录类型为‘001’),数据中的“交收日期”字段的内容为 T+1 日,但“交收数量”字段的内容不再填写。结算参与人必须依据证券变动文件进行实际股份过户处理,而不能根据结算明细文件进行过户。但在与投资者进行清算时,本文件中包含了具体的交易明细信息。在结算明细文件增加了很多和风险控制相关的数据,有些业务数据也有相应的变化,具体请参见我公司公布的《T+1 货银对付业务结算参与人数据接口说明》。

7. 在结算明细文件中增加了‘005’和‘901’两种记录类型,其目的是什么?

新增记录类型是为了方便参与人进行处理及统计。如‘005’表示为账户式国债质押类记录,包括国债质押出入库、标准券折算率调整等业务引发的标准券变化均通过该类记录体现,便于参与人追踪账户式质押相关的标准券变化信息。而‘901’类记录则体现了与货银对付制度相关的风险控制方面的数据。

8. 未正常交收的证券数据从哪儿获得?是否可以和成交数据相对应?

T+1 日日终,未正常交收的证券数据可从结算明细文件中获取,这部分数据或转入参与人证券处置账户,或成为待处分证券。在 T+2 日日终,结算明细文件中会发送待处分证券返还数据。上述数据均无法和成交明细相对应。

9. 企债的变动数据通过什么文件发送?在证券变动文件中包括这方面的数据

吗？

在证券变动文件中只发送和证券账户相关的所有变动,不包括企债的变动数据,该数据仍通过现有接口文件中的 e2 文件发送。e2 文件中企债变动数量分为交易与非交易两类,对于交易类,为在 T-1 日交易成交并在 T 日以债券主席位为结算单位的实际交收的净额轧差数量。此外,企债的持有数据也不通过证券余额文件发送,在其他数量文件中发送,数据类型为‘003’。

10. 在业务回报文件中包括当日申报失败和撤销的回报吗？回报数据和申报数据是否一一对应？

业务回报文件中不包括当日申报失败和撤销的回报数据,仅发送成功受理且未被撤销申报的回报数据。对于待处分证券申报,系统对当日成功申报的数量进行汇总处理,回报数据中的“成功数量”表示实际成功处理的数量;对于参与人证券交收账户及证券处置账户留存证券划转申报和投资者违约申报,系统对当日成功申报的数据按照受理编号逐笔处理,“成功数量”表示实际成功处理的数量。

11. 和 T+1 货银对付制度相关的 PROP 申报包括哪些？申报及处理规则是什么？

包括待处分证券申报、参与人证券交收账户及证券处置账户留存证券划转申报、投资者违约申报和当天申报情况查询等,所有申报的请求文件和应答文件的格式相同,但填写规则有差异。申报及处理的规则如下:

- (1) 各业务的申报时间为 9:00-15:00。
- (2) 每类业务每天可以多次申报,每次的申报数量必须大于 0。
- (3) 系统实时对申报内容进行格式检查和数据内容检查,实时返回申报受理结果。
- (4) 一次可以申报多笔,申报编号必填且同一批的申报编号不可重复(否则该次申报失败),按申报编号从小到大的顺序依次处理;中间失败的记录不影响后续记录的处理。
- (5) 参与人可以根据申报时返回的受理编号对当天申报的某笔数据进行撤销。

此外,对于待处分证券的申报查询,在返回的查询结果中包括某笔申报的充抵金额,并包括一条汇总记录,反映当天已经受理的所有待处分证券的累计充抵金额。