



深圳证券交易所工程技术文档

深圳证券交易所 融资融券业务券商技术系统变更指南

V1.13 (试点)



深圳证券交易所 电脑工程部
中国结算深圳分公司 电脑工程部

二 一 年三月二十二日

关于本文档

文档名称		深圳证券交易所融资融券业务券商技术系统变更指南	
说明		为券商等相关单位进行融资融券业务相关技术准备工作的指南	
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2006-05-19	V1.0(征)		初始版本
2006-06-06	V1.00(试)	修订	主要修订如下： 增加指令申报的特别说明； 对融资融券余额数据文件的申报，增加“本日融资强制平仓”、“本日融券强制平仓”申报内容，增加申报记录应按证券代码由小到大排序”的要求； 修改了“本日融资偿还额”的字段名； 信用违约资料的申报和发布，增加“券商名称”内容； 相关数据接口规范以V4.39版发布，将新股申购撤单和申购回报的接口定义并入。
2006-06-28	V1.01(试)	修订	主要修订如下： 个别术语与试点实施细则统一，如“担保品”改为“担保物”，“担保折扣率”改为“折算率”； “融资融券标的证券信息”和“担保物信息”两公告文件分别确定为XXyymmdd.999、XXyymmdd.998； 补充说明：信用证券账户在融资融券专用交易单元上普通买入的证券应属于担保物证券范围； 融券卖出股票、基金的委托数量应是100股(份)的整数倍。
2006-07-10	V1.02(试)	修订	“担保物信息”公告文件（XXyymmdd.998）改名为“可允抵保证金证券信息”公告文件

2006-07-25	V1.03(试)	修订	<p>“融资融券标的证券信息”公告文件（XXyyymmdd.999）原两标志内容改为“融资标的”、“融券标的”两标志，增加“当日可融资”、“当日可融券”两类标志信息；</p> <p>强调融资融券业务数据申报的截止时间点为当日晚上10:00。要求证券公司如未能在通常申报时间（如晚9:00）成功申报，则应启动应急流程，向交易所有关人员报告。</p>
2006-08-22	V1.10(试)	修订	<p>证券融资融券业务数据申报，补充了如下方面的说明：</p> <p>当日交易发生额数据，以当天交易的清算数据为准；</p> <p>如标的证券为净价交易的债券，当日融资买入金额、当日融券余额金额以全价计算；</p> <p>增加了对除权日申报数据的特别说明；</p> <p>报送的数据不应包含包括佣金或交易经手费等费用部分。</p>
2008-10-15	V1.11(试)	修订	<p>将原信用专席修改为融资融券专用交易单元，及部分文字修订。业务相关内容无任何变更。</p>
2008-11-03	V1.12(试)	修订	<p>补充对融资融券余额数据申报的说明。</p> <p>增加对融资融券相关结算交收顺序、资金结算数据接收的相关说明。</p>
2010-03-22	V1.13(试)	修订	<p>配合业务指南修订：</p> <p>由于可充抵保证金证券的折算率可以为0，删除原可充抵保证金证券通过SJSXXN发布的说明</p> <p>补充说明本所发布的可充抵保证金证券清单中不包含暂停上市证券，证券公司需自行维护暂停上市证券的折算率。</p> <p>根据业务指南中前端控制要求补充了5.1.5指令申报的说明。</p> <p>补充说明完整违约信息通过会员专区定向发布。</p> <p>其它文字修订。</p>

注：最新修订以橙色字体标示。

目 录

一、	说明.....	1
二、	融资融券业务简介.....	1
2.1	业务简介	2
2.2	业务框架	2
2.3	业务资格管理	3
2.4	融资融券非交易过户	4
三、	融资融券标的证券及可充抵保证金证券信息发布.....	5
3.1	融资融券标的的信息	5
3.2	可充抵保证金证券信息	5
3.3	保证金比例信息	5
四、	信用证券账户开户.....	6
五、	融资融券交易.....	6
5.1	交易申报	6
5.2	成交回报	9
5.3	逐日盯市及强制平仓	11
六、	融资融券交易过户.....	11
七、	融资融券非交易过户.....	12
7.1	担保证券提交与返回	14
7.2	融券券源划拨	14
7.3	现券还券划拨	15
7.4	非交易报送库的填报	15
八、	融资融券业务数据申报.....	16
8.1	融资融券余额数据	16
8.2	信用违约资料	19
九、	融资融券交易信息披露.....	20
十、	券商技术系统要求.....	21
十一、	其它说明.....	22
附件 1 :	融资融券标的的证券信息 (XXyymmdd.899)	23
附件 2 :	融资融券可充抵保证金证券信息 (XXyymmdd.898)	24

深圳证券交易所

融资融券业务券商技术系统变更指南

一、 说明

根据融资融券业务的要求，本所会同中国结算深圳分公司对数据接口规范进行了修订。为便于相关会员公司和相应 IT 提供商更好地理解接口规范和了解相关技术系统要求，尽快做好会员公司端技术系统的准备工作，本所会同中国结算深圳分公司联合编制和发布本指南文档。

编制本文档的依据：《证券公司融资融券业务试点管理办法》（证监会于 2006 年 7 月 3 日发布）、《深圳证券交易所融资融券交易试点实施细则》、《中国结算深圳分公司融资融券登记结算业务实施方案》、《深圳证券交易所融资融券交易试点会员业务指南（2010 年修订）》；本所原有的技术系统接口。

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

业务咨询电话：

交易：(0755) 25918165

结算：(0755) 25946017

技术咨询电话：

交易：(0755) 25918503、25918187

结算：(0755) 25946048

特别提示：该指南只包括深圳市场提供的业务服务，供有关单位参考。如果业务规则及业务方案有所变更，本文档也可能会有所变更。

二、 融资融券业务简介

下面简要介绍深市融资融券交易业务方案，详细内容请参阅《深圳证券交易所融资融券交易试点实施细则》和《中国结算深圳分公司融资融券登记结算业务实施方案》。

2.1 业务简介

融资融券交易，也称信用交易或保证金交易。

融资交易：投资者向证券公司提交保证金，借入资金买入标的证券。买入的标的证券同时作为投资者向证券公司融资的担保物。

融券交易：投资者向证券公司提交保证金，借入证券并卖出标的证券。卖出的价款连同投资者提交的保证金一起作为投资者融券的担保物。

融资融券业务包含以下要素：

- ✓ 标的证券（允许融资买入的证券、融券卖出的证券）
- ✓ 可充抵保证金证券种类及折算率
- ✓ 融资年利率/融券费率（融出方收益）
- ✓ 偿还日期（合约期限一般不超过半年）
- ✓ 融入方（证券账户、资金账户）
- ✓ 融出方（证券账户、资金账户）
- ✓ 保证金比例、强行平仓条件（客户维持担保比例）

融资/融券合约，由证券公司与客户订定，但须符合相关法律法规和管理部门融资融券业务的规定。

对于融资交易，投资者可通过直接还款的方式了结融资合约。对于融券交易，投资者可通过融券买入（即买券还券）或直接还券的方式了结融资合约。

2.2 业务框架

参与融资融券业务的投资者需向试点券商申请开立专门的信用证券账户，券商认定客户资质后（接受申请），与投资者签订信用交易协议，并通过现有开户代理系统为投资者办理开户事宜；结算公司划定专门的代码区间以供开立信用证券账户。

融资融券业务通过证券公司**融资融券专用交易单元**进行。券商接受投资者的融资融券交易指令后，通过**融资融券专用交易单元**向深交所申报，申报应当标注“融资”或“融券”。

投资者向证券公司申请融资或融券时交存的保证金、融资买入的证券或融券卖出的款项作为对证券公司的担保。证券公司实行逐日盯市，即每天对客户融资

买入的标的证券、客户融券卖出的标的证券以及提交充抵保证金的证券的价格变化进行跟踪，计算客户担保物是否充足。如果客户担保物不足，证券公司应当发出追缴保证金指令要求客户追加保证金。客户未能追加的，证券公司有权按照程序采取强行平仓等措施，其买卖申报应当标注“强制平仓”。

结算公司为证券公司开立一级专用证券账户——“客户信用交易担保证券账户”，用于记载信用交易客户持有的证券总量；为投资者开立信用交易客户二级账户——“信用证券账户”，用于记载信用交易客户融资买入的证券、融券卖出证券和充抵保证金证券的余额。由于信用交易客户二级账户也由结算公司根据信用交易成交记录等信息维护，结算公司可以穿透证券公司一级专用证券账户直接看到客户二级账户，因而称为“看穿式”二级账户体系。

结算公司为证券公司开立信用交易专用结算备付金账户、结算保证金账户和专用证券交收账户，用于办理信用交易的资金和证券交收。通过[融资融券专用交易单元](#)达成的普通交易（即担保品买卖）或信用交易均通过证券公司信用交易专用结算备付金账户办理资金交收。

证券公司以自己的名义在商业银行分别开立融资专用资金账户（用于存放拟向客户融出的资金及客户归还的资金）和客户信用交易担保资金账户（用于存放客户交存的充当信用交易担保物的资金）。投资者从事融资融券交易的，证券公司为其在商业银行处开立信用资金账户，该资金账户是证券公司客户信用交易担保资金账户的二级账户，用于记载客户交存担保资金的明细数据，由商业银行根据证券公司提供的数据进行维护。

2.3 业务资格管理

证券公司经营融资融券业务，必须经中国证券监督管理委员会（以下简称证监会）批准。交易所根据证监会颁发的融资融券业务经营许可，受理证券公司开通[融资融券专用交易单元](#)的申请，对通过批准的[融资融券专用交易单元](#)设置融资融券业务权限。

交易所可根据本所监管需要、证监会要求或结算公司提请等限制、暂停或中止证券公司融资或（和）融券业务交易权限。

2.4 融资融券非交易过户

证券公司可根据投资者的委托或自身业务需要通过 D-COM 系统向结算公司提交与融资融券业务相关的证券非交易过户指令。T 日提交的非交易过户指令，只对 T 日已完成交收的证券进行处理。

相关非交易过户指令包括以下几类：

(1) 担保证券提交与返回

此类业务一般适用于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提交或收回担保证券，投资者须通过划出证券的证券公司托管单元提交申报，申报其普通证券账户和信用证券账户作为划入划出账户，同时附有划入账户的托管单元信息。结算公司对接收到的指令进行有效性检查，对于有效指令办理过户处理，记减划出账户的证券余额，记增划入账户的证券余额并托管于指定的托管单元中。

(2) 融券券源划拨

此类业务一般适用于证券公司划出或收回可供融出的担保证券。证券公司在提交此类非交易过户业务时，须通过划出证券的托管单元提交申报，直接申报其自营证券账户和融券专用证券账户作为划入划出账户，同时附有划入账户的托管单元信息。结算公司对接收到的指令进行有效性检查，对于有效指令办理过户处理，记减划出账户的证券余额，记增划入账户的证券余额并托管于指定的托管单元中。

(3) 现券还券划拨

此类业务一般适用于客户信用证券账户与证券公司融券专用证券账户之间进行直接还券业务或还券过程中所涉及的多退少补事宜，划出方须通过划出证券的证券公司托管单元提交申报，申报其信用证券账户和证券公司融券专用证券账户作为划入划出账户；同时附有划入账户的托管单元信息。接到上述非交易过户指令后，结算公司记减划出账户的证券余额，记增划入账户的证券余额并托管于指定的托管单元中。

投资者若须将普通证券账户的相关证券直接用于归还融券，须先申报将相关证券划入信用证券账户（上述第 1 类非交易过户指令），之后（可于当日）再申报将相关证券划入证券公司融券专用证券账户（上述第 3 类非交易过户指令）。

三、 融资融券标的证券及可充抵保证金证券信息发布

3.1 融资融券标的的信息

交易所每日通过 www.szse.cn 网站发布融资融券标的的证券信息，证券公司可从网站查询或下载相关信息。例：

证券代码	证券简称	融资标的	融券标的	当日可融资	当日可融券
000001	深发展 A	Y	N	Y	N
159901	深 100ETF	Y	Y	Y	Y

以上发布内容可导出为 CSV 格式。

交易所每个交易日开市前通过交易系统发布信息公告(标准格式为 TXT 文件，文件名 XXyymmdd.899，其中 yymmdd 为发布日期，文件样式见附件 1)。

此外，交易所还通过数据接口中的新证券信息库 (SJSXXN.dbf) 发布以上信息。

3.2 可充抵保证金证券信息

交易所每日通过 www.szse.cn 网站发布融资融券可充抵保证金证券 (证券) 信息，证券公司可从网站查询或下载相关信息。例：

证券代码	证券简称	折算率 (%)
000001	深发展 A	60.00
159901	深 100ETF	90.00

以上发布内容可导出为 CSV 格式。

交易所每个交易日开市前通过交易系统发布信息公告(标准格式为 TXT 文件，文件名 XXyymmdd.898，其中 yymmdd 为发布日期，文件样式见附件 2)。

因暂停上市证券在交易系统中已暂时摘牌，本所发布的可充抵保证金证券信息不包含暂停上市证券，证券公司需自行维护暂停上市证券的折算率。

3.3 保证金比例信息

在融资融券保证金比例信息发生调整时，交易所通过交易系统和网站 www.szse.cn 发布公告，证券公司可自行查询或下载相关信息。内容包括：

融资保证金比例	融券保证金比例	客户维持担保比例
---------	---------	----------

50%

50%

130%

四、信用证券账户开户

通过现有的数据接口 SJSKW.dbf(开户委托库)进行开户 ,增加两类账户类别 :
‘8’=个人信用证券账户 ; ‘9’ = 机构信用证券账户。业务类别和回报方式不变。

(注 : 信用证券账户代码为 ‘06XXXXXXXX’)

五、融资融券交易

5.1 交易申报

投资者可使用信用证券账户进行普通交易 (相应买卖委托不需向证券公司融资或融券 , 即担保品买卖) 和信用交易。投资者进行信用交易时 , 必须通过[融资融券专用交易单元](#)进行 , 其交易申报应当标注“融资”或“融券”。若是证券公司进行强制平仓的 , 应当标注“强制平仓”。

为申报相关标识 , 数据接口规范中委托库接口 (SJSWT.dbf) 修订如下 :

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WHTXHX	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

说明 : 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 : 现金交易 (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‘ ’）。

5.1.1 融资交易

投资者以其信用账户的资金或证券作为担保物，向证券公司申请融资买入，其买入申报应包含投资者“信用证券账户”代码，并注明“融资”标识；证券公司在与结算公司交收时通过信用交易备付金账户为投资者垫付资金；投资者融资买入的证券直接划入证券公司“客户信用担保专用证券账户”，成为向证券公司融资的担保物；结算公司同时维护该账户下投资者二级明细，记增“客户信用担保专用证券账户”下该客户“信用证券账户”余额。

投资者偿还融资买入款，采用直接还款方式。客户可以通过卖出信用证券账户内证券所得资金偿还融资款，还可以从其普通资金账户划转资金至证券公司融资专用资金账户用以偿还融资款。

5.1.2 融券交易

投资者以其信用账户中的资金或证券作为担保物，向证券公司申请融券卖出，其卖出申报应包含投资者“信用证券账户”代码，并注明“融券”标识；证券公司在与结算公司交收时将其“融券专用证券账户”的证券为投资者垫付证券；投资者融券卖出所得资金通过信用交易备付金账户划入投资者信用资金账户中，作为向证券公司融券的担保物。

投资者偿还融入证券，可采用直接还券或买券还券两种方式。直接还券的投资者向证券公司提出申请，由证券公司向结算公司申请前述“现券还券划拨”类非交易过户，将投资者证券从其信用证券账户划入证券公司“融券专用证券账户”；投资者若须将普通证券账户的相关证券直接用于归还融券，须先申报将相关证券划入信用证券账户（前述“担保物提交”类非交易过户指令），之后再申报“现券还券划拨”类非交易过户以还券。“买券还券的投资者可通过其“信用证券账户”申报买券，其买入申报应包含投资者“信用证券账户”代码，并注明“融券”标识；投资者买入证券直接记入证券公司“融券专用证券账户”。

由于交易规则对买入数量单位的限制，在融券合约数量有零股的情况下，可能造成买券还券的数量超过融券余额的情况，此时需进行退券（余券返还）处理，证券公司应当在 T+1 日前（T 日或 T+1 日）申报退券（“R3”划券指令）将投资者多还的券退还给投资者，其申报数量=当日投资者融券买入数量+现券偿还数量+强制平仓数量-（前日融券合约余量+当日投资者融券卖出数量）。

5.1.3 强制平仓交易

强制平仓交易与融资交易中的卖出担保证券还款和融券交易中的买券还券类似，但其买卖申报除了标注“融资”或“融券”外，还应加注“强制平仓”标识，以和投资者的偿还操作区分。

5.1.4 各类交易指令填报标识内容

指令种类	WTMARK[1]	WTMARK[2]
普通交易 (即普通买入或普通卖出)	‘ ’ (空格)	‘ ’ (空格)
融资买入	‘1’	‘ ’ (空格)
融资卖出 (融资强制平仓)	‘1’	‘3’
融券卖出	‘2’	‘ ’ (空格)
融券买入 (即买券还券)	‘2’	‘ ’ (空格)
融券买入 (融券强制平仓)	‘2’	‘3’

注：投资者卖券还款时，交易指令可申报融资标识（WTMARK[1]为‘1’，WTMARK[2]为空格）也可不申报（同普通交易），由券商系统自行决定。

5.1.5 关于指令申报的特别说明

(1) 信用证券账户只能在融资融券专用交易单元上交易，普通证券账户只能在普通交易单元（非融资融券专用交易单元）上交易；否则，交易主机将对相应买卖指令作自动撤单处理。

(2) 普通证券账户禁止申报带“融资”/“融券”标识的买卖指令，否则，将被交易主机作自动撤单处理。

(3) 信用证券账户在**融资融券专用交易单元**上，除可开展信用交易外，也可开展普通交易（标识内容的填报见上表）。

对于信用证券账户在**融资融券专用交易单元**上申报的**融资买入**委托，交易主机检查买入证券是否为融资标的券，当前是否允许融资买入；对于信用证券账户在**融资融券专用交易单元**上申报的**融券卖出**委托，交易主机检查卖出证券是否为融券标的券，当前是否允许融券卖出；对于信用证券账户在**融资融券专用交易单元**上申报的**普通买入**（即 WTMARK[1]、WTMARK[2]两标识都为‘ ’的买入指令）委托，交易主机检查买入证券是否为担保物证券范围内的证券。对于未通过合法性检查的申报，交易主机将作自动撤单处理。

(4) 证券公司可根据自身业务需要，申报带“**卖券还款**”标识的指令（即 WTMARK[1]为‘1’、WTMARK[2]为‘ ’的卖出指令），交易主机视同普通卖出指令处理，成交回报时返回原申报的融资融券相关标识。

(5) “融资”/“融券”标识对配股认购、新股发行、债券挂牌分销、ETF 申购赎回等等非交易指令无实际意义，交易主机不查看非交易指令的融资融券标识。

(6) 客户融资买入、融券卖出的数量应当为 100 股（份）或其整数倍；

(7) 客户买券还券的数量不得高于其融券余量 + 100 股（份）；

(8) 客户信用证券账户不得用于从事新股申购、定向增发、债券回购、预受要约、LOF 申购及赎回、现金选择权申报、LOF 和债券的跨市场转出以及证券质押。

(9) 证券公司融券专户不能用于交易。

(10) 证券公司不得融出超过融券专用证券账户证券数量的证券，不得融出超过融资专用资金账户资金余额的资金。

(11) 申报融券卖出委托时，证券公司技术系统应确保委托中的证券帐户为有效账户。

5.2 成交回报

数据接口规范中成交回报库接口（SJSHB.dbf）修订如下：

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	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
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	HBYWLB	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
14	HBYYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明：

- 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；

‘’：现金交易。

第二位标识开、平仓信息：

‘1’：开仓（预留）；

‘2’：平仓（预留）；

‘3’：强制平仓；

‘’：普通交易。

- HBCDYY（字段 12：撤单原因）增加融资融券业务相关定义：

交易主机自动撤单含义表（表五）

HBCDYY	HBDFGD	具体含义
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
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或 融券卖出价格低于规定价格
23	无效单元	该交易单元无权经营该业务或

HBCDYY	HBDFGD	具体含义
		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
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）
99	其他错误	因其他原因导致的交易主机自动撤单

5.3 逐日盯市及强制平仓

(1) 逐日盯市

证券公司在符合交易所有关规定的基礎上，确定交易标的证券和担保证券的种类、可充抵保证金证券的折算率、初始保证金和客户维持担保比例。证券公司接受客户融资融券交易指令前，应当收取初始保证金。

保证金计算和风控方案见融资融券交易试点实施细则。

证券公司应建立逐日盯市制度，每日监控投资者（信用账户）的客户维持担保比例，当该比例低于该警戒线比例时，需提醒投资者补充担保物，若投资者未能按要求补充担保物，证券公司有权发出强制平仓指令。

(2) 融资强制平仓

融资还款的强制平仓交易与普通卖出申报操作类似。卖出申报应包含投资者信用证券账户代码，并注明“融资”和“强制平仓”标识。融资强制平仓卖出所得资金首先偿还投资者所欠证券公司资金

(3) 融券强制平仓

融券还券的强制平仓交易与融券还券交易操作类似。买入申报应包含投资者信用证券账户代码，并注明“融券”和“强制平仓”标识。融券强制平仓买入证券直接划入证券公司融券专用证券账户。

六、 融资融券交易过户

对于[融资融券专用交易单元](#)的交易记录，在进行交易过户时，结算公司对于投资者信用账户的标识为“融资”的买卖，视为证券公司信用交易担保证券账户的买

卖；对于标识“融券”的买卖，对券商融券专用账户进行记加或记减。

结算公司每日将通过 SJSDZ.dbf 发送投资者信用账户明细账。

七、融资融券非交易过户

在结算交收顺序上，交易指令优先，即：先处理交易成交，然后对证券划拨指令（R1、R2、R3 指令）按申报顺序进行处理。

结算公司 D-COM 系统提供实时数据接口，包括 FJYBS.dbf（非交易报送库）和 FJYQR.dbf（非交易确认库）。FJYBS.dbf 用于券商申报非交易过户指令；结算公司对券商所申报指令进行基本检查，并将结果通过 FJYQR.dbf 实时反馈给券商。D-COM 系统目前只向券商法人提供。

最终的非交易过户处理结果将仍通过 SJSGF.dbf 反馈给证券公司。

结算公司在 SJXW.dbf 中增加**融资融券专用托管单元**的信息，XWXWLB='X' 表示**融资融券专用托管单元**。证券公司在进行非交易过户时务必参考相关信息。

FJYBS.dbf（非交易报送库）和 FJYQR.dbf（非交易确认库）的结构如下：

(1) 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	保留
9	BSGFXZ	股份性质	C	2	保留
10	BSWTSL	委托数量	N	12,0	
11	BSWTZJ	委托资金	N	16,3	
12	BSWTJG	委托价格	N	9,3	
13	BSBZ1	标志 1	C	1	保留
14	BSBZ2	标志 2	C	1	保留
15	BSDFXW	对方托管编码	C	6	
16	BSDFGD	对方证券账户	C	10	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
17	BSDFXZ	对方股份性质	C	2	保留
18	BSNR1	备注内容 1	C	60	保留
19	BSNR2	备注内容 2	C	120	保留
20	BSRQ1	日期 1	N	8,0	保留
21	BSRQ2	日期 2	N	8,0	保留
22	BSWTRQ	委托日期	D		必填项
23	BSWTSJ	委托写入时间	C	8	必填项, HHMMSSXX
24	BSCLBZ	处理标志	C	1	必填项
25	BSBYZD	备用标志	C	1	券商系统自用

(2) 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	
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

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
26	QRQSBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

7.1 担保证券提交与返回

这类业务的业务类别是“R1”。

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 填其普通证券账户，BSDFGD 填其信用证券账户，BSDFXW 填划入的融资融券专用托管单元，同时填报证券代码和证券数量。

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，投资者在其融资融券专用托管单元进行申报，BSGDDM 填其信用证券账户，BSDFGD 填其普通证券账户，BSDFXW 填其普通证券账户托管单元，同时填报证券代码和证券数量。

最终的非交易过户处理结果通过 SJSGF.dbf 反馈，每笔非交易过户指令拆分成 2 条结果记录，划出方记减，划入方记加，业务类别与 FJYBS 库相同，也是“R1”。其中，GFSFZH 中前 10 位为对方股东代码，最后 6 位为对方托管单元。

7.2 融券券源划拨

这类业务的业务类别是“R2”。

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 填其自营证券账户，BSDFGD 填其融券专用证券账户，BSDFXW 填其融资融券专用托管单元，同时填报证券代码和证券数量。

证券公司由其融券专用证券账户划出时，在其所在的融资融券专用托管单元进行申报，BSGDDM 填其融券专用证券账户，BSDFGD 填其自营证券账户，BSDFXW 填其自营证券账户托管单元，同时填报证券代码和证券数量。

最终的非交易过户处理结果通过 SJSGF.dbf 反馈，每笔非交易过户指令拆分成 2 条结果记录，划出方记减，划入方记加，业务类别与 FJYBS 库相同，也是“R2”。其中，GFSFZH 中前 10 位为对方股东代码，最后 6 位为对方托管单元代码。

7.3 现券还券划拨

这类业务的业务类别是“R3”。

投资者向证券公司还券时，由投资者在其[融资融券专用托管单元](#)申报，BSGDDM 填投资者的信用证券账户，BSDFGD 填证券公司融券专用证券账户，同时填报证券代码和证券数量。

证券公司向投资者退券时，由证券公司在其[融资融券专用托管单元](#)申报，BSGDDM 填证券公司融券专用证券账户，BSDFGD 填投资者的信用证券账户，同时填报证券代码和证券数量。

最终的非交易过户处理结果通过 SJSGF.dbf 反馈，每笔非交易过户指令拆分成 2 条结果记录，划出方记减，划入方记加，业务类别与 FJYBS 库相同，也是“R3”。其中，GFSFZH 中前 10 位为对方股东代码。

7.4 非交易报送库的填报

FJYBS.DBF 作为非交易指令上报的数据接口库，需要根据不同业务类别进行填报，具体请参见下表。

BSYWLB	BSWTLX	非必填项字段的填报说明
R1	S/申报	BSZQDM,BSGDDM,BSXWDM,BSWTSL,BSDFXW,BSDFGD。 从投资者普通证券账户向客户信用交易担保专用证券账户提交担保时，投资者在普通证券账户托管单元进行申报，BSGDDM 为其普通证券账户，BSDFGD 为其信用证券账户，BSDFXW 为 融资融券专用托管单元 。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 融资融券专用托管单元 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。
		无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
	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 融资融券专用托管单元 。证券公司由其融券专用证券账户划出时，在其所在的 融资融券专用托管单元 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。
		无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
	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 融资融券专用托管单元 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 融资融券专用托管单元 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。
		无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
	C/撤单	无。 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。

八、融资融券业务数据申报

每日收盘后，证券公司应于约定时间（晚 10：00 前）通过双向通信系统向交易所申报有关融资融券余额，及向交易所申报信用违约资料等业务数据，申报格式为 DBF 格式。

8.1 融资融券余额数据

申报文件名为 XYnnnnnn.DBF，其中 nnnnnn 为融资融券专用交易单元代码。

字段定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XYZQDM	证券代码	C	6	
2	XYZRRZYE	前日融资余额	N	14,0	金额，以元为单位

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
3	XYJRRZMR	当日融资买入额	N	14,0	数量，以股/份/张等为单位
4	XYJRRZCH	当日融资偿还额	N	14,0	
5	XYZRRJYE	前日融券余量	N	14,0	
6	XYJRRJMC	当日融券卖出数量	N	14,0	
7	XYJRRJMR	当日融券买入数量	N	14,0	
8	XYJRXJCH	当日现券偿还数量	N	14,0	
9	XYRZPC	当日融资强制平仓额	N	14,0	金额，以元为单位
10	XYRJPC	当日融券强制平仓量	N	14,0	数量，以股/份/张等为单位
11	XYJRRZYE	当日融资余额	N	14,0	金额，以元为单位
12	XYJRRJYE	当日融券余量金额	N	14,0	融券余量*当日收盘价。以元为单位
13	XYJYRQ	信用交易发生日期	D	8	CCYYMMDD

说明：

(1) 当日融资余额=前日融资余额+当日融资买入-当日融资偿还额；

当日融券余量数量=前日融券余量+当日融券卖出数量-当日融券买入数量-当日现券偿还数量；

当日融券余量金额=当日融券余量数量*当日收盘价；

如标的证券为净价交易的国债，当日融资买入金额=融资买入数量*结算价格=融资买入数*(成交价格+当日每百元应计利息额)；当日融券余量金额=本日融券余额数量*(当日收盘价+当日每百元应计利息额)。

(2) 当日融资买入金额、当日融券卖出数量、当日融券买入数量、当日融资强制平仓金额、当日融券强制平仓量等当日交易发生额数据，以当天交易的清算数据为准。

其中，“当日融券买入数量”(XYJRRJMR)的申报数量应当为“融券买入”交易指令(包括投资者主动下达的买券还券交易指令、强制平仓交易指令)达成成交而实际了结掉的融券合约数量，即证券公司申报的“当日融券买入数量”<=买券还券指令成交数量+强制融券平仓交易指令成交数量。也就是说，当融券买入(包含强制融券平仓)交易指令成交数量超过融券合约数量时，应申报实际了结的融券合约数量，投资者多还部分(即超出融券合约数量部分)的退券视为修正处理，不纳入申报数据。

(3) 通常,当日申报数据中的“前日融券余量”应与前一交易日申报的“当日融

券余量”相等，但在当日发生因送红股而除权的情形下，当日申报数据中的“前日融券余额”不等于前一交易日申报的“当日融券余额”，其计算方法如下：

✚ 对于未实行 T+1 日 DVP 交收的证券，结算公司于股权登记日（R 日）下午收市后进行权益分派到账处理，证券于 R+1 日除权：证券公司在 R 日完成融资融券余额数据申报后，应对融券余额大于 0 的客户进行记借红股处理（例如，某投资者融券了 100 股，送股比例为 0.1，则将该投资者记借 100 股调整为记借 110 股，计算结果精确至股或份），于 R+1 日申报的“前日融券余量”=所有融券客户记借红股处理后的融券数量总计=R 日申报的“当日融券余量”+记借红股总量。

✚ 对于实行 T+1 日 DVP 交收的证券，证券于 R 日除权，结算公司于 R 日下午收市后进行权益分派到账处理：证券公司在 R-1 日完成融资融券余额数据申报后，应对融券余额大于 0 的客户进行记借红股处理（例如，某投资者融券了 100 股，送股比例为 0.1，则将该投资者记借 100 股调整为记借 110 股，计算结果精确至股或份），于 R 日申报的“前日融券余量”=所有融券客户记借红股处理后的融券数量总计=R-1 日申报的“当日融券余量”+记借红股总量。

注：目前实行 T+1 日 DVP 交收的品种中，ETF 将作为融资融券业务试点的标的证券，但 ETF 一般以派息方式分红，故建议融资融券业务试点券商，先期技术准备不予考虑第 所及的对实行 T+1 日 DVP 交收标的证券的处理，将之纳入配合结算公司 T+1 日 DVP 交收改革的技术改造工程中。

(4) 报送的数据不应包含包括佣金或交易经手费等费用部分。如，“当日融资买入额”=融资买入成交数量*成交价格，不包括交易印花税和佣金等费用部分；“当日融资偿还额”，应为扣除交纳交易印花税和佣金及融资费用后实际了结的融资合约额。

(5) 上表中，“当日融资偿还额”包含“本日融资强制平仓额”，“当日融券买入数量”包含“当日融券强制平仓量”。

(6) 上表中金额类字段，计算过程中精确至 0.001 元，最终结果精确至 1 元。

(7) 当证券代码为‘999999’时，代表该笔记录为所有标的证券的总计金额。

序号	字段名	字段描述	说明
1	XYZQDM	证券代码	值为‘999999’

2	XYZRRZYE	前日融资余额	前日融资余额总金额
3	XYJRRZMR	当日融资买入额	当日融资买入总金额
4	XYJRRZCH	当日融资偿还额	当日融资偿还总金额
5	XYZRRJYE	前日融券余额	0
6	XYJRRJMC	当日融券卖出数量	0
7	XYJRRJMR	当日融券买入数量	0
8	XYJRXJCH	当日现券偿还数量	0
9	XYRZPC	当日融资强制平仓额	0
10	XYRJPC	当日融券强制平仓量	0
11	XYJRRZYE	当日融资余额	当日融资余额总金额
12	XYJRRJYE	当日融券余额金额	当日融券余额总金额

(8) 如某标的证券前日融资余额、前日融券余额都为零，且当日无融资融券业务发生，则可不申报该证券的记录。申报数据中必须包含汇总记录（证券代码为‘999999’），即使所有标的证券的余额数据都为 0。

(9) 申报记录应按证券代码由小到大排序。

(10) 证券公司应确保每交易日正确申报该数据，申报的截止时间点为当日晚 上 10：00。如证券公司因故未能于通常申报时间（如晚 9：00）成功申报，应启动应急流程，向交易所有关人员报告。

(11) 如证券公司在约定时间（晚 10：00）前有多次申报，则以最后一次申报的数据为准。

8.2 信用违约资料

申报文件名为 WYnnnnnn.DBF，其中 nnnnnn 为融资融券专用交易单元代码。

字段定义如下：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	WYXWDM	交易单元代码	C	6	融资融券专用交易单元代码
2	WYZQMC	券商名称	C	40	券商名称
3	WYGDDM	违约者证券账户	C	10	
4	WYGDXM	违约者姓名	C	60	
5	WYSFZH	身份证号	C	30	
6	WYWYJE	违约金额	N	10	
7	WYWYLB	违约类别	C	1	‘1’：未按规定补足担保物 ‘2’：合约期满未清偿 ‘3’：提供虚假信息

					'4': 发生司法纠纷
8	WYSBLB	申报类别	C	1	'1': 新增 '2': 撤销 '3': 结案
9	WYSBRQ	申报日期	D	8	CCYYMMDD
10	WYMARK		C	2	备用

说明：

交易所于约定的截止时间点（每交易日晚上 10：00）前接收信用违约资料的申报。如券商多次申报，则以最后收到的数据为准。交易所汇总各券商的数据，并以 XYWYZL.DBF（库结构同 WYnnnnnn.DBF）通过双向通信系统自动发送给券商。

由于违约汇总资料为每日的变更情况而并非当前完整的违约信息，券商需根据变更情况（新增、撤销、结案）维护违约信息。此外，本所也会维护一份当前的完整违约信息，通过会员专区向有融资融券业务权限的会员发布。

九、融资融券交易信息披露

交易所通过现有交易公开信息披露渠道（网站和交易网络等），揭示以下信息：

（1）每交易日开市前公告的信息

融资融券标的的证券的证券代码、证券简称、保证金比例等。如有调整，可在每交易日开市前更新。

可充抵保证金证券的证券代码、证券简称、折算率等。如有调整，可在每交易日开市前更新。

前一交易日信用交易总量信息。主要包括前一交易日融资买入额、前一交易日融资还款额、当日融资余额和前一交易日融券卖出量、前一交易日融券买入量、前一交易日现券偿还数量、当日融券余额以及融资融券两者合计等信息。其中：

当日融资余额=前日融资余额+前日融资买入额-前日融资还款额；

当日融券余额=前日融券余额+前日融券卖出量-前日融券买入量-前日现券偿还数量。

上述公式中，融资数据按金额统计，融券数据按证券数量统计，两者合计量按金额统计。

前一交易日单只证券信用交易明细信息。主要包括前一交易日融资买

入额、前一交易日融资还款额、当日融资余额和前一交易日融券卖出量、前一交易日融券买入量、前一交易日现券偿还数量、当日融券余额以及融资融券两者合计等信息。其中，融资数据仍按金额统计，融券数据仍按证券数量统计，但两者合计量按证券数量统计。

(2) 每月、每季度或不定期公告的信息

📌 证券公司信用交易业务概况。可按月或按季度统计各证券公司每月或每季度融资融券业务发生额平均数及其市场占有率排名，便于投资者参考。

📌 融资融券标的证券、可充抵保证金证券调整公告。主要内容包括新增或取消的融资融券标的证券或可充抵保证金证券的证券代码、证券简称、担保比例及相关的执行时间等内容。

📌 担保比例、保证金比例调整公告。主要内容包括可充抵保证金证券折算比例、保证金比例调整幅度、调整原因及相关的执行时间等内容。

十、 券商技术系统要求

券商技术系统进行相应改造后，应能满足以下业务需求：

- 📌 支持投资者开立信用账户
- 📌 支持证券非交易过户指令的申报和处理支持（包括投资者提交和收回担保物）
- 📌 投资者委托渠道上，支持融资融券业务相关委托指令
- 📌 增加对信用交易委托指令的处理功能
- 📌 支持对信用交易的结算交收的特别处理
- 📌 每日清算后，在约定时间前向交易所申报当日信用交易业务数据
- 📌 客户信用信息管理及共享（包括黑名单）
- 📌 担保物实时监控（逐日盯市）及强制平仓
- 📌 行情分析软件：可查询到交易所发出的融资融券业务相关信息

券商系统对于投资者下达的融资融券交易指令，相比于普通交易指令，应特别做好以下前端合法性检查和控制：

- 1、只有信用证券账户才能且只能通过融资融券专用交易单元进行交易,即禁止投资者信用证券账户在普通交易单元交易,禁止普通证券账户在融资融券专用交易单元,禁止普通证券账户在普通交易单元上发出“融资”/“融券”标识的委托指令;
- 2、融资买入的证券应属于当日本所允许的可融资买入证券范围,融券卖出的证券应属于当日本所允许的可融券卖出证券范围;普通买入(即 WTMARK[1]、WTMARK[2]两标识都为‘ ’)的证券应属于担保物证券范围。
- 3、风控检查:投资者保证金可用余额足够(即满足初始保证金等要求);
- 4、对于融券卖出申报,卖出股票、基金的委托数量应为 100 股(份)的整数倍(即与证券买入数量单位相同),且“融券专用账户”仍有足额证券可供卖出;
- 5、融资融券业务额应不超出本公司的规模限制。

此外,还应做好信用证券账户不能交易债券回购、证券公司融券账户不能用于交易的控制。

关于融资融券相关资金结算数据的接收,建议券商通过 D-COM 系统接收 SJSZJ.DBF 和 SJSQS.DBF,若需通过交易网关接收这两个接口数据,券商须向中国结算深圳分公司资金交收部申报传送交易单元代码,相应数据将通过该交易单元分发。

十一、其它说明

本指南适用于具有融资融券业务资格的券商的相关技术准备工作,其他券商无须根据此指南做任何技术调整。

其它参考文档:《深圳证券交易所数据接口规范》(V4.39 以上)

(最新发布版本为 V4.57)

附件 1：融资融券标的的证券信息 (XXyymmdd.899)

发送日期: 20060519

发送时间: 08:42:15

信息类型: 信息公告

消息来源: 深圳证券交易所

主标题: 深圳证券市场融资融券标的的证券信息

副标题: 深圳证券交易所信息公告[2006-587]号

主题词: 融资融券信息

深圳证券市场融资融券标的的证券信息

(2006 年 5 月 19 日)

证券代码	证券简称	融资标的	融券标的	当日可融资	当日可融券
000001	深发展 A	Y	N	Y	N
159901	深 100ETF	Y	Y	Y	Y
.....					

附件 2：融资融券可充抵保证金证券信息（XXyymmdd.898）

发送日期: 20060519

发送时间: 08:42:15

信息类型: 信息公告

消息来源: 深圳证券交易所

主标题: 深圳证券市场融资融券可充抵保证金证券信息

副标题: 深圳证券交易所信息公告[2006-588]号

主题词: 融资融券信息

深圳证券市场融资融券可充抵保证金证券信息

（2006 年 5 月 19 日）

证券代码	证券简称	折算率（%）
000001	深发展 A	60.00
159901	深 100ETF	90.00
.....		