

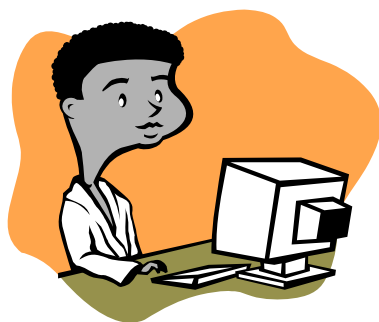


中国结算深圳分公司工程技术文档

中国结算深圳分公司

**T+1DVP 结算模式改革与证券商（结算参与人）**

**技术接口变更指南**



电脑工程部

二〇〇六年七月七日

## 目 录

1. 说明	3
2. T+1DVP 结算模式简介	3
2.1、T+1DVP 覆盖的业务范围	4
2.2、DVP 清算与交收流程	4
3. 交易类业务T+1DVP处理	6
3.1、T日清算数据下传	6
3.2、T + 1 日交收数据下传	8
3.3、证券划拨指令申报及确认	8
4. 发行类业务	9
4.1、交收方式	9
4.2、资金交收方面的变化	9
5. 无对价物资金处理	9
6. 其它接口变化	10
7. 券商系统支持T+1DVP结算模式的注意事项	10

# 中国结算深圳分公司 T+1 DVP 结算模式改革与券商（结算参与人） 技术接口变更指南

## 1. 说明

- 1.1. 为便于参与深圳市场业务的券商和相应 IT 提供商更好地理解 T+1 货银对付结算模式和相关技术系统变化，尽快做好券商端技术系统的准备工作，中国结算深圳分公司编制和发布本指南文档。
- 1.2. 编制本文档的依据是《货银对付业务实施方案》、《深市货银对付登记结算业务指南》、《深圳证券交易所数据接口规范 Ver4.50》和《中国结算深圳分公司结算参与人数据接口规范 Ver1.10》。
- 1.3. 我公司改造系统的宗旨是从技术上保障证券结算安全进行，同时，尽量减少系统改造对券商系统带来的影响。
- 1.4. 本文中未涉及的内容请参考中国结算深圳分公司公布的业务实施细则及现有业务规则。
- 1.5. 咨询电话  
业务： 0755 - 25946001, 0755 - 25946002  
技术： 0755 - 25946080

## 2. T+1DVP 结算模式简介

DVP (*Delivery Versus Payment*, 即“货银对付”)是指证券登记结算机构(以下简称“本公司”)与结算参与人在交收过程中,当且仅当资金交付时给付证券、证券交付时给付资金。

“T+1 DVP”是指交收期为 T+1 日的证券、资金净额对付结算制度和模式。它改变了过去证券和资金交收脱节的状况,降低了证券市场的结算风

险。

## 2.1、T+1DVP 覆盖的业务范围

“T+1DVP”覆盖的业务范围为主板（不含B股）和中小企业板已纳入净额清算、担保交收的业务品种，具体包括：

第一，二级市场交易类业务：A股、封闭式基金、LOF、权证、ETF（含交易和申购赎回）、可转债、国债、企业债等证券交易（含大宗交易）以及债券质押式回购。

第二，原担保交收的发行类业务：配股认购、国债分销。

注：本次技术改造未涉及本公司三板结算系统。

## 2.2、DVP 清算与交收流程

### ①T 日清算

T 日，本公司对深交所的成交数据进行清算：计算各种费用，生成参与人资金及股份的应收、应付净额，对当日净卖出证券进行交收锁定，将证券及资金清算数据（SJS MX.DBF、SJS QS.DBF、SJS GF.DBF 等）下发结算参与人。

### ②T+1 交收

T+1 日，本公司根据 T 日清算结果，完成证券和资金的交收，下发交收结果给结算参与人（SJS ZJ.DBF、SJS GF.DBF、SJS DZ.DBF 等）。

### ③T+1 申报证券划拨指令

结算参与人可通过 D-COM 系统实时向本公司申报证券划拨指令，详见 FJYBS.DBF 接口。

若 T+1 日结算参与人资金透支，则应该向本公司申报证券待处分指令（业务类别‘7F’），本公司据此确定待处分证券，并完成其余应收证券的

划拨。若结算参与人不能及时上报有效的证券待处分指令，则本公司将其 T+1 所有净应收证券都作为待处分证券。

若投资者对结算参与人资金违约，结算参与人可以申报投资者违约指令（业务类别 ‘7J’），本公司据此将投资者应收证券划入结算参与人证券处置帐户。

另外，结算参与人可实时查询待处分证券申报汇总数据和投资者违约申报汇总数据（通过 FJYBS.DBF 和 FJYQR.DBF 接口，业务类别分别为 ‘Q1’ 和 ‘Q2’）。

注：若资金透支导致证券待处分，进而导致证券卖空，则本公司将进行卖空冲销，用待处分证券冲抵卖空证券，并通过 SJS GF.DBF 中 ‘W5’ 业务回报结算参与人。

#### **④T+2 确定拟处置证券**

T+2 日，若结算参与人不再资金透支，则其全部待处分证券可申请划回；若继续透支，本公司从其待处分证券中确定拟处置证券，剩余证券结算参与人可申请划回。

本公司将剩余证券的数量通过 SJS FW.DBF 接口（业务类别 ‘25’）告知结算参与人，以便其 T+3 日申请划回。

#### **⑤T+3 证券处置及剩余证券划回**

T+3 日起，本公司将委托证券公司将 T+2 确定的拟处置证券在二级市场卖出，用于弥补资金透支。

参与人 T+3 日须通过 D-COM 申报证券划回指令将相关剩余证券划回原买入帐户或其证券处置帐户，详见 FJYBS.DBF 接口。

注：投资者补足违约资金后，结算参与人可申请将其证券处置帐户中的证券划回相关投资者证券帐户。

### 3. 交易类业务 T+1DVP 处理

#### 3.1、T 日清算数据下传

T 日收市后，本公司对交易类成交数据进行清算，下发证券及资金清算明细与汇总数据给结算参与人，具体包括投资者证券帐户级的清算明细数据（SJS MX.DBF）、托管席位级的清算数据（SJS QS.DBF）和结算参与人交收帐户级的清算数据（SJS FW.DBF）等。

因本公司不再对 T 日交易涉及的资金进行预记 T+1 日帐的处理，故 T 日 SJS ZJ.DBF 中不再包含 T 日交易的帐务变更数据。

**案例：**假如张三 T 日从席位甲以每股 5.00 元买入 1000 股证券 A，以每股 5.10 买入 2000 股证券 A，以每股 3.80 元卖出 3000 股证券 B，则 T 日，参与人 SJS MX.DBF 中会收到 3 笔清算明细数据：

序号	字段名	字段描述	类型	长度	清算明细数据回报（3笔记录）		
					买入 1000 股证券 A	买入 2000 股证券 A	卖出 3000 股证券 B
1	MXZJJS	资金结算 主席位	C	6	席位甲对应的资金 结算主席位	席位甲对应的资金 结算主席位	席位甲对应的资金 结算主席位
2	MXXWDM	席位代码	C	6	席位甲的席位代码	席位甲的席位代码	席位甲的席位代码
3	MXJSFS	交收方式	C	1	D	D	D
4	MXYWLB	业务类别	C	2	00	00	00
5	MXZQDM	证券代码	C	6	证券 A 的证券代码	证券 A 的证券代码	证券 B 的证券代码
6	MXGDDM	股东代码	C	10	张三的证券帐户	张三的证券帐户	张三的证券帐户
7	MXQSGS	清算股数	N	12, 0	1000	2000	- 3000
8	MXQSZJ	清算资金	N	17, 2	- 1000 × 5.00	- 2000 × 5.10	3000 × 3.80
9	MXYHS	印花税	N	12, 2	负数（若有该税）	负数（若有该税）	负数（若有该税）
10	MXJYF	交易经手	N	12, 2	负数（若有该费）	负数（若有该费）	负数（若有该费）

		费（含监管规费）					
11	<b>MXGHF</b>	过户费	N	12, 2	负数（若有该费）	负数（若有该费）	负数（若有该费）
12	<b>MXJSF</b>	结算费	N	12, 2	负数（若有该费）	负数（若有该费）	负数（若有该费）
13	<b>MXSXF</b>	手续费	N	12, 2	0	0	0
14	<b>MXJE1</b>	资金金额 1	N	17, 2	保留资金字段	保留资金字段	保留资金字段
15	<b>MXJE2</b>	资金金额 2	N	17, 2	保留资金字段	保留资金字段	保留资金字段
16	<b>MXXH</b>	序号	C	9	深交所的成交号码	深交所的成交号码	深交所的成交号码
17	<b>MXJYBS</b>	交易标识	C	1	见接口描述	见接口描述	见接口描述
18	<b>MXPCBS</b>	平仓标识	C	1	见接口描述	见接口描述	见接口描述
19	<b>MXCJRQ</b>	成交日期	D		T 日	T 日	T 日
20	<b>MXQSRQ</b>	清算日期	D		T 日	T 日	T 日
21	<b>MXJSRQ</b>	交收日期	D		T+1 日	T+1 日	T+1 日
22	<b>MXFSRQ</b>	发送日期	D		T 日	T 日	T 日
23	<b>MXBY1</b>	备用字段 1	C	12	保留字段	保留字段	保留字段
24	<b>MXBY2</b>	备用字段 2	C	6	保留字段	保留字段	保留字段
25	<b>MXBYBZ</b>	备用标志	C	1	券商系统自用	券商系统自用	券商系统自用

清算明细库 SJSMX.DBF 的其它说明：

- 对于非担保大宗交易，业务类别为 ‘DZ’，目前包括专项资产管理计划；
- 对于 ETF 的申购赎回，SJSMX.DBF 中包含业务类别为 ‘L4’、‘L5’ 的明细记录，包括组合券信息。
- 对于融券交易，SJSMX.DBF 中包含融券交易证券划转数据（业务类别

‘R3’), 即融券卖出或买券还券时, 投资者信用证券账户与证券公司融券专用证券账户的非交易过户股数。

另外, 本公司:

- 通过 SJSQS.DBF 下传席位汇总的清算数据;
- 通过 SJSFW.DBF (D-COM 平台) 下传结算参与人证券交收帐户及资金交收帐户的应收付净额数据 (业务类别分别为 ‘23’、‘24’ )。

### 3.2、T+1 日交收数据下传

T+1 正常交收后的股份余额体现在 SJSDZ.DBF 中; 交收违约后相关风险处置证券信息体现在 SJSGF.DBF 中。

若因资金透支造成证券待处分, 则待处分证券仍然通过 SJSGF.DBF 中业务类别 ‘B8’ 的记录回报。

卖空冲销仍然通过 SJSGF.DBF 中 ‘W5’ 业务回报。

T+1 资金交收后的资金对帐数据仍通过 SJSZJ.DBF 下传。

### 3.3、证券划拨指令申报及确认

结算参与人可通过 D-COM 系统按 FJYBS.DBF 接口实时申报待处分券(业务类别 ‘7F’ )、投资者违约申报 (业务类别 ‘7J’ ) 以及证券划回指令 (业务类别 ‘7G’ ), 通过 FJYQR.DBF 实时接收申报确认, 通过 SJSGF.DBF 中的有关记录获知最后处理结果。详见《深圳证券交易所数据接口规范 Ver4.50》。

另外, 结算参与人通过 FJYBS.DBF 查询待处分证券申报汇总数据和投资者违约申报汇总数据 (业务类别分别为 ‘Q1’ 和 ‘Q2’ ), 通过 FJYQR.DBF 实时获取查询结果; 本公司通过 SJSFW.DBF 中 ‘25’ 业务告知结算参与人在待处分证券被处置后可划回的剩余证券余额。



## 4. 发行类业务

### 4.1、交收方式

配股认购、国债分销采用担保 DVP 交收方式。而网上定价、网上竞价、定价增发、竞价增发、LOF/ETF 多日发行等仍然采用过去的非担保交收方式。

### 4.2、资金交收方面的变化

除新股冻结资金解冻仍然采用预记帐处理外，发行业务的其它阶段取消 T 日预记 T+1 日帐的资金记帐方式，改在 T+1 日进行资金交收和帐务处理。

T 日在资金清算库 SJSQS.DBF 中增加新股发行资金数据(业务类别‘01’)和配股认购资金数据(业务类别‘22’)。参与者据此完成 T+1 日发行类资金交收。

配股认购、国债分销若资金交收透支，待处分券仍通过 SJSQF.DBF 中‘B8’业务类别回报。

## 5. 无对价物资金处理

对于无对价物资金项目，不再采用 T 日预记 T+1 日帐的资金记帐方式，改为 T 日清算，T+1 日进行资金交收和帐户处理。

T 日在资金清算库 SJSQS.DBF 中增加各种无对价物资金的清算数据：转托管费、保证金调整、透支罚息、结算资金结息、利息调整、司法冻结资金结息、非交易过户、QFII 非交易过户、股份变更历史查询、柜台开户费、股份质押手续费、特别报盘转让、担保证券提交与返还、融券券源划拨、现券还券划拨等，纳入 T+1 资金交收处理。

详见《深圳证券交易所数据接口规范 Ver4.50》。

## 6. 其它接口变化

### ①质押式回购

质押式回购原来的回报（业务类别‘70’和‘72’）无法区分质押和出入库回报，新的接口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（SJSGF.DBF 中增加业务类别‘74’），以适应 T+1DVP 结算模式带来的变化。

### ②流通股冻结

在实时非交易报送接口 FJYBS.DBF 中增加流通股冻结内容（业务类别分别为‘7A’、‘7B’、‘7C’、‘7D’、‘7E’）。

若结算参与人通过实时接口 FJYBS.DBF 申报流通股冻结业务，则通过原非实时接口 SJSSQ.DBF 申报的流通股冻结申请无效。

## 7. 券商系统支持 T+1DVP 结算模式的注意事项

●增加了清算明细库 SJSMX.DBF, 内含明细到投资者的每一笔交易成交及部分非交易业务委托的清算数据。本公司通过 D-COM 向券商及托管银行结算参与人发送该库。

SJSMX.DBF 中的业务，在 SJSQS.DBF 中均有涵盖。

●为了减少券商系统改造的工作量，清算明细库 SJSMX.DBF 中增加了行权等明细清算数据的同时仍然保留 SJSGF.DBF 中行权类回报。

●券商可通过 SJSDZ.DBF 和 SJSMX.DBF 等数据自行计算证券可交易量。

●SJSTJ.DBF 仍保留原来业务数据，调整了 TJBGHF 和 TJSGHF 的字段定义。

●SJSGF.DBF 中取消了交收锁定数据（业务类别‘B1’），冻结数据（业务类别‘B2’）改为只包括流通股冻结股数，不再包含交收锁定股数。增加了证券划回确认、投资者违约的回报，取消了 QFII 成交回报（‘0B’、‘0S’）。将权证行权（‘W0’、‘W1’、‘W2’、‘W3’、‘W4’）和要约收购中（‘78’）中，应交付

金额或转让金额从扣税费改为未扣税费。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。

- 除了 QFII 托管银行，基金托管银行也可以通过 D-COM 接收 SJSQF.DBF 和 SJSDZ.DBF。

- 对 SJSQS.DBF 进行了修订，详见《深圳证券交易所数据接口规范 Ver4.50》。

- 在 SJSQS.DBF 中增加证券交收违约扣款（含债券回购欠库扣款）。

- 交易类业务的资金清算数据将从 SJSQS.DBF 中获取，不再从 SJSZJ.DBF 中获取，T+1 日 SJSZJ.DBF 中有最终的资金交收帐务数据。

- 发行类资金（新股冻结资金解冻除外）以及无对价物券商应付资金不再 T 日预记 T+1 日帐，券商将从 SJSQS.DBF 中接收清算数据，T+1 日进行资金交收。

- 修订了实时非交易报送接口 FJYBS.DBF，详见《深圳证券交易所数据接口规范 Ver4.50》。

- 对于流通股冻结业务，若通过实时接口 FJYBS.DBF 上报数据，则非实时接口 SJSSQ.DBF 中的申报无效。

- 投资者 T 日进行交易后，其证券余额 T+1 日体现在 SJSDZ.DBF 中。

- 修订了结算参与人接口 SJSFW.DBF，通过 SJSFW.DBF 提供证券和资金应收付净额数据、拟退剩余证券余额数据及权益分派参数。详见《中国结算深圳分公司结算参与人数据接口规范 Ver1.10》。

- 本次技术改造未涉及本公司三板结算系统。