

中国结算深圳分公司关于公司债和资产证券化业务相关数据接口 规范变化的说明（测试用稿）

2007-09-24

1. 说明

- 1.1. 为便于参与深圳市场业务的券商（结算参与人）和相应 IT 提供商更好地理解公司债及资产证券化相关技术系统变化，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（以下简称“本公司”）编制和发布本接口说明文档。
- 1.2. 本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。
- 1.3. 本文中涉及的内容以本公司正式公布的业务指南等为准。附件为《公司债登记结算业务方案基本安排（测试用稿）》。
- 1.4. 本接口变化启用时间另行通知。
- 1.5. 咨询电话
0755-25946080（技术）

2. 公司债业务结算模式及接口简介

根据公司债相关业务方案和规则，公司债集中竞价交易采用 T+1DVP 担保交收方式，公司债大宗交易采用 T+1 非担保 DVP 交收（逐笔全额交收）方式。

目前，采用 T+1DVP 担保交收的品种有权证和 ETF 交易，资产证券化产品走大宗交易通道，采用逐笔全额非担保模式。

公司债集中竞价交易的接口参照原来权证和 ETF 的交易结算接口方案；对公司债大宗交易以及资产证券化，新增两项内容：交易当日（T 日）

下发清算数据（SJSQS.DBF）；T+1 日通过 SJSQF.DBF 中‘B9’业务下发交收失败数据（注意：对资产证券化业务，不再借用‘41’业务发送交收成功数据）。

详见下文。

3、公司债数据接口说明

①T 日清算

T 日收市后，本公司对交易类成交数据进行清算，下发按托管单元汇总的清算数据（SJSQS.DBF）给结算参与人。

SJSQS.DBF 具体参见《深交所数据接口规范 Ver4.53》，只是在清算业务含义表中增加公司债券种以及公司债大宗交易及资产证券化业务的描述【将补充到后续版本的接口规范中】：

清算业务含义表（表十七）

QSYWLB	相应业务含义	说明
00	交易清算数据	<p>QSZQDH 为证券类别，例如： ‘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。</p> <p>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。</p>
DZ	大宗交易平台非担保清算数据	<p>QSZQDH 为证券代号</p> <p>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。</p>

因公司债采用 T+1 DVP 交收，本公司不对 T 日交易涉及的资金进行预记 T+1 日帐的处理，故 T 日 SJSZJ.DBF 中不再包含 T 日交易的帐务变更数据。

交易统计数据 SJSTJ.DBF 中包含公司债的集中竞价交易统计，不含公司

债大宗交易的统计。

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（SJSZJ.DBF、SJSGF.DBF、SJSDZ.DBF 等）。

T 日的交易，股份余额在 T+1 正常交收后才体现在 SJSDZ.DBF 中；交收违约后相关风险处置证券信息体现在 SJSGF.DBF 中。

对于公司债集中竞价交易，若因资金透支造成证券待处分，则待处分证券通过 SJSGF.DBF 中业务类别‘B8’的记录回报。

卖空冲销通过 SJSGF.DBF 中‘W5’业务回报。

对于公司债大宗交易及资产证券化，通过 SJSGF.DBF 中‘B9’业务回报交收失败数据，详见下表——业务类别含义（表七）**【将补充到后续版本的接口规范中】**。对资产证券化业务，不再借用‘41’业务发送交收成功数据。

T+1 资金交收后的资金对帐数据通过 SJSZJ.DBF 下传，包含公司债集中竞价交易的资金交收数据以及公司债大宗交易及资产证券化非担保交收成功的资金。

业务类别含义表（表七）

GFYWLB	相应业务含义	GFQRGS			GFZJJE		
B9	<p>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。</p>	交收失败股数	>0 或<0	Y	成交价格	>0	N

附件：公司债登记结算业务方案基本安排（测试用稿）

一、公司债发行

公司债主要拟采用网上挂牌分销与网下配售相结合的发行方式，以满足多日发行的现实需求。

公司债网上挂牌分销主要比照现有企业债网上发行的业务模式办理，在结算环节贯彻非担保 DVP 交收原则。

对于同时采用老股东优先配售方式发行的公司债，比照新股增发中的老股东优先配售业务模式办理，在结算环节贯彻非担保 DVP 交收原则。

公司债网上挂牌分销和老股东优先认购同日开始，但采用不同的代码。在网上挂牌分销截止日之前，已确认未被老股东认购的公司债可继续用于网上挂牌分销。

公司债网上挂牌分销的发行和老股东优先认购采用不同的代码，在办理登记业务时转换为统一的代码；相关网上及网下债券登记业务比照现有业务模式办理。

对于拟采用网上资金申购方式发行的公司债，其结算业务比照新股资金申购网上发行的相关业务规定办理。

二、公司债集中交易

公司债二级市场集中交易将采用 T+1DVP 担保交收模式，结算系统将公司债纳入 DVP 交收品种，相关结算业务比照权证和 ETF 交易的业务模式办理；在涉及交收违约扣券时，扣券顺序为先 ETF，其次公司债，最后为权证。

公司债集中交易金额纳入结算备付金和结算保证金的计算基数。

三、公司债回购

日后公司债将纳入现有企业债质押式回购业务。

鉴于公司债为 T+1 日交收（适应 DVP 交收需要），有别于企业债；故其质押券申报入库时间将比企业债相应推迟一天，相关安排如下：投资者 T 日买入的公司债，T+1 日可通过参与人申报质押券入库手续，T+1 日晚，在完成 T 日公司债交易的交收处理后，结算公司根据实际到账的公司债余额做入库处理。若公司债足额，结算公司按参与人申报将相关公司债转入质押库，并将相关数据发送交易所前端监控；自 T+2 日（质押券入库次日）开始，该转入质押库的公司债可用于债券回购。

其他有关债券回购业务的登记结算业务比照现有业务模式办理。

四、公司债大宗交易

（一）对于日后通过大宗交易平台（或深交所日后拟建设的综合协议交易平台）成交的公司债业务，拟采用 T+1 非担保 DVP 交收（逐笔全额交收）模式，相关登记结算业务比照资产证券化产品现有业务模式办理。

（二）适应公司债业务实际需要，将对资产证券化产品交收做出如下调整：

1、增加发送清算数据：结算系统在 T 日晚将向参与人发送资产证券化产品和公司债大宗交易等非担保交收业务清算结果。

2、调整交收时间：资产证券化产品业务交收时间将后移至现有

非担保 DVP 交收阶段处理，亦即由 T+1 日 14:30 移至 T+1 日 16:00 之后。相关非担保 DVP 交收业务的办理顺序为：权证行权、资产证券化产品转让、公司债大宗交易。

（三）由于公司债转让同时可以通过集中撮合交易和大宗交易，为避免次日集中撮合交易出现卖空，对于 T 日通过大宗交易卖出的公司债，在计算前端监控所用的可用余额时，将根据 T 日晚清算结果（逐笔应付证券合计数）予以扣减，次日不得卖出。

由于通过大宗交易平台成交的公司债业务适用 T+1 非担保 DVP 交收模式，在计算前端监控所用的可用余额时，不将 T 日通过大宗交易买入的债券纳入可用余额，该部分买入债券在 T+2 日（交收到账日的次日）方可卖出或转托管。

五、其他相关登记结算业务

公司债兑付利息、兑付本金及其他相关登记结算业务，比照现有债券业务模式办理。

在股权登记日安排和除息处理方面，适应公司债 T+1 交收特点须做出适应性调整：其股权登记日（R 日）与除息日同日，而最后交易日则为 R-1 日。