

报价回购业务数据接口说明

（供国信证券）

一、中国结算上海分公司发结算参与人

（一）jsmx（结算明细文件）

1）YWLX（业务类型）：

“117” 报价回购业务

“118” 报价回购的购回业务

2）ZQDM1(证券代码 1)： 报价回购代码“205” 开头

3）数据填写说明：

字段名	长度	说明	报价回购业务	报价回购的购回业务
SCDM	2	市场代码	01	01
JLLX	3	记录类型	002（交收通知）/ 003（交收结果）	002（交收通知）/ 003（交收结果）
JYFS	3	交易方式	104（报价回购交易）	104（报价回购交易）
JSFS	3	交收方式	002（非担保）	002（非担保）
YWLX	3	业务类型	117	118
QSBZ	3	清算标志	02B	22B
GHLX	3	过户类型	#	#
JSBH	16	交收编号	#	#
CJBH	10	成交编号	*	*
SQBH	10	申请编号	*	*
WTBH	12	委托编号	#	#
JYRQ	8	交易日期	回购成交日 T	回购成交日 T
QSRQ	8	清算日期	无论是否延迟交收，均 填写回购成交日 T	到期购回清算日 R，注： 正常购回时，无论是否延迟交收，R 为 $\geq R_z$ 的最早的工作日； 提前终止时，R 为申报日
JSRQ	8	交收日期	正常交收时，填写回购 成交日 T； 延迟交收时，填写回购 成交日下一日 T+1	到期购回交收日 R，注： 正常购回时，R 为 $\geq R_z$ 的最早的工作日； 提前终止时，R 为申报 日； 延迟交收时，R 为正常交

				收日的下一工作日
QTRQ	8	其它日期	到期购回自然日 Rz	到期购回自然日 Rz
WTSJ	6	委托时间		
CJSJ	6	成交时间		
XWH1	5	业务单元 1	交易单元	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元	结算单元
XWHY	8	业务单元 1 所属 结算参与人的清 算编号	交易单元所属结算参与 人的清算编号	交易单元所属结算参与 人的清算编号
JSHY	8	结算参与人的清 算编号	结算单元所属结算参与 人的清算编号	结算单元所属结算参与 人的清算编号
TGHY	8	托管银行的清算 编号	#	#
ZQZH	10	证券账号	*	*
ZQDM1	6	证券代码 1	填写 205 代码	填写 205 代码
ZQDM2	6	证券代码 2	#	#
ZQLB	2	证券类别	#	#
LTLX	1	流通类型	#	#
QYLB	2	权益类别	#	#
GPNF	4	挂牌年份	#	#
MMBZ	1	买卖标志	“B” 融资（自营） “S” 融券（客户）	“B” 融资（自营） “S” 融券（客户）
SL	12	交收数量	#	#
CJSL	12	成交数量	ABS(交易成交数量× 1000)	ABS(交易成交数量× 1000)
ZJZH	25	资金账号	非担保交收账号	非担保交收账号
BZ	3	币种	RMB	RMB
JG1	17	价格 1	100.000000, 注: 百元 价	购回结算价（百元价）， 注： 正常购回时，按照到期购 回成交价计算收益； 提前终止时，按照提前购 回成交价计算收益
JG2	17	价格 2	到期正常购回的成交 价，注: 百元价	成交价（百元价），注： 正常购回时，填写到期购 回成交价； 提前终止时，按照提前购 回成交价
QSJE	17	清算金额	ABS(成交数量×价格 1 ÷100) ×收付方向 融资方为正，融券方为 负	ABS(成交数量×价格 1 ÷100) ×收付方向 融资方为负，融券方为正
YHS	17	印花税	印花税	印花税

JSF	17	经手费	经手费	经手费
GHF	17	过户费	过户费	过户费
ZGF	17	证管费	证管费	证管费
SXF	17	手续费	手续费	手续费
QTJE1	17	其它金额 1	0.00	0.00
QTJE2	17	其它金额 2	0.00	0.00
QTJE3	17	其它金额 3	0.00	0.00
SJSF	17	实际收付	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用
JGDM	4	结果代码	交收通知：“0000” 交收结果：见说明	交收通知：“0000” 交收结果：见说明
FJSM	40	附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志的附加说明

说明：

1. 延迟交收的记录不进行重新清算，在下一工作日合并进入当天净额非担保处理；
2. JGDM(结果代码)：

JGDM	说明
买方状态：	
0000	正常交收
0098	对方不交收
0499	本方资金余额不足，对方情况未知
卖方状态：	
0000	正常交收
9800	对方不交收
9904	对方情况未知，本方资金余额不足

(二)wdq(未到期业务对账文件)

- 1) 文件名称：wdqXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)。
- 2) 数据内容：包含未到期业务的对账信息，包括未到期回购业务（买断式回购和账户式质押回购等）对账数据。
- 3) 文件生成单位：清算编号。
- 4) 发送目标：结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间：每个交易日日终后。
- 6) 发送周期：每个交易日。
- 7) 数据格式：FOXPRO2.5下的标准DBF格式：

NO	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		清算编号
3	WDQLB	Character	3		未到期类别

NO	字段名	类型	长度	格式定义	说明
4	ZQZH	Character	10		证券账户
5	XWH1	Character	5		业务单元 1
6	XWH2	Character	5		业务单元 2
7	ZQDM	Character	6		证券代码
8	ZQLB	Character	2		证券类别
9	LTLX	Character	1		流通类型
10	QYLB	Character	2		权益类别
11	GPNF	Character	4		挂牌年份
12	CJXLH	Character	16		成交序列号
13	CJBH	Character	16		成交编号
14	SQBH	Character	16		申请编号
15	WTBH	Character	16		委托编号
16	JSBH	Character	16		交收编号
17	MMBZ	Character	1		买卖标志
18	SL1	Character	12	±999999999999	数量 1
19	SL2	Character	12	±999999999999	数量 2
20	JG1	Character	17	9999999.999999999	价格 1
21	JG2	Character	17	9999999.999999999	价格 2
22	JE1	Character	17	±9999999999999.99	金额 1
23	JE2	Character	17	±9999999999999.99	金额 2
24	CJRQ	Character	8		成交日期
25	QTRQ	Character	8		其他日期
26	FZDM	Character	10		辅助代码
27	BCSM	Character	40		补充说明

8) 数据说明:

(1) WDQLB: 定义了未到期业务数据的类别, 定义如下:

002: 买断式回购未到期数据

003: 账户式质押回购未到期数据

数据填写详细说明:

字段名	长度	说明	报价回购未到期数据
SCDM	2	市场代码	‘01’
QSBH	8	清算编号	清算编号
WDQLB	3	未到期类别	‘004’ (报价回购未到期数据)
ZQZH	10	证券账户	证券账户
XWH1	5	业务单元 1	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元
ZQDM	6	证券代码	报价回购代码

字段名	长度	说明	报价回购 未到期数据
ZQLB	2	证券类别	#
LT LX	1	流通类型	#
QYLB	2	权益类别	#
GPNF	4	挂牌年份	#
CJXLH	16	成交序列号	#
CJBH	16	成交编号	成交编号
SQBH	16	申请编号	申请编号
WTBH	16	委托编号	委托编号
JSBH	16	交收编号	#
MMBZ	1	买卖标志	‘B’：融资（自营） ‘S’：融券（客户）
SL1	12	数量 1	未到期数量（融资方、融券方均正数，单位为元）
SL2	12	数量 2	#
JG1	17	价格 1	到期购回成交价格，百元价
JG2	17	价格 2	提前终止成交价格，百元价
JE1	17	金额 1	#
JE2	17	金额 2	#
CJRQ	8	成交日期	成交日期
QTRQ	8	其他日期	到期自然日
FZDM	10	辅助代码	空：正常未到期 ‘YCJS’：延迟交收
BCSM	40	补充说明	#

注：

- (1) 若到期自然日为工作日，在该日交收；若到期自然日为非工作日，在下一个工作日交收。
- (2) 若辅助代码出现‘YCJS’，说明出现了延迟交收的情况。下一日若不能完成交收将进入清盘程序。进入清盘程序后，不再发送报价回购未到期数据。

(三) zqbd(证券变动文件)和zqye(证券余额对账文件)

出入库的结果在zqbd文件中体现，变动类型为‘00N’，入库自营账户证券过出、出库自营账户证券过入。日终后持有可核对zqye文件。