



深圳证券交易所工程技术文档

深圳证券交易所跨市场 ETF 业务 券商技术系统变更指南

(Ver 1.1)



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
二〇一一年十月

关于本文档

文档名称		深圳证券交易所跨市场ETF业务券商技术系统变更指南	
说明		为券商等相关单位进行跨市场ETF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
2009-11-26	Ver0.9	创建	征求意见稿
2009-12-1	Ver1.0	修订	原跨市场ETF业务券商技术系统变更指南的正式发布稿
2011-10-19	Ver1.1	修订	在原正式发布稿的基础上进行修订, 相比原稿, 主要有以下变更: 1、申购业务的结算模式改为T+1逐笔全额非担保DVP模式, 赎回份额改为T+1逐笔全额非担保模式（非DVP） 2、由于结算模式变更, 跨市场ETF当日申购份额当日不能卖出, T+2日可以卖出或赎回。 备注: 结算接口的修订本次新增内容仅包括LA、LB、LC、LD等业务相关说明。ETF代收代付相关内容以前通过《中国结算深圳分公司ETF业务数据接口修订说明》发布过, 为方便查阅, 本次也加入了本文档, 但并非新增内容。

注: 本次修订的重点以红色字体标示。

目 录

一、	说明	1
二、	跨市场 ETF 业务简介	2
2.1	恒指 ETF 简介	2
2.2	跨市场 ETF 业务介绍	2
三、	跨市场 ETF 和本市场 ETF 的不同点	6
四、	跨市场 ETF 的主要技术变更	8
4.1	申购赎回清单	8
4.2	深交所数据接口规范的调整	12
4.3	结算参与人接口规范的调整	14
4.4	基金管理人接口规范的调整	15
五、	券商系统支持跨市场 ETF 业务的注意事项	15
六、	附件一：恒指 ETF 申购赎回清单	15
七、	附件二：SJSGE.DBF 中新增业务详细描述	19
八、	附件三：SJSMXn.DBF 定义及填写说明(n 为整数数字，表示批次).....	21
九、	附件四：明细交收结果 SJSJG.DBF 定义及填写说明	27

深圳证券交易所

跨市场 ETF 业务券商技术系统变更指南

一、说明

为便于参与深圳证券交易所（以下简称深交所）跨市场 ETF 的会员公司和相应 IT 提供商更好地理解跨市场 ETF 业务和了解相关技术系统，尽快做好会员公司端技术系统的准备工作，本所编制和发布本指南文档。

本文档中的跨市场 ETF 泛指包含有非深圳市场（以下简称“深市”）成份股的 ETF，但目前本文档只着重于恒指 ETF，**该种跨市场 ETF 通过深交所交易系统进行中购赎回**。未来如有其他类型的跨市场 ETF，本所将根据需要及时修改并发布本文档。

编制本文档的依据：华夏基金管理有限公司（以下简称华夏基金公司）恒生指数 ETF 产品方案；本所当前正使用的技术系统接口；本所已发布的针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》。

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，要减少系统改造对会员公司带来的影响。

本文中未涉及的内容请参考深交所及中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称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。

技术咨询电话：（0755）25918199

（0755）25918503

（0755）25946080（中国结算深圳分公司）

业务咨询电话：（0755）25918536

特别提示：本文档主要介绍跨市场 ETF（**通过深交所交易系统进行中购赎回，下同**）和现有本市场 ETF 业务的不同，以及由此导致的技术变更，相同的部分请各会员单位参考针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》。

该指南包括深交所和中国结算深圳分公司提供的业务服务，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。

请各会员单位根据自身需要，参照本指南的相应内容，做好相关的技术准备

工作。

二、跨市场 ETF 业务简介

2.1 恒指 ETF 简介

恒指 ETF 属于港股 ETF，紧密跟踪标的指数（香港恒生指数），追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，其业绩比较基准为香港恒生指数。

恒指 ETF 主要投资于跟踪标的指数的成份股、备选成份股及替代性股票。为更好地实现投资目标，还可投资于香港证券市场的债券、基金(包括股票基金、债券基金、交易所交易基金等)、金融衍生工具(包括远期合约、互换、期货、期权、权证等)、符合证监会要求的银行存款等货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

恒指 ETF 主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

2.2 跨市场 ETF 业务介绍

下面以恒指 ETF 为例简要介绍跨市场 ETF 业务模式，主要包括基金的发行认购，上市交易，申购赎回，基金份额参考净值（IOPV）揭示。

2.2.1 证券编码

跨市场 ETF 使用 1599xx 证券代码区间，和本市场 ETF 统一顺序编码。

2.2.2 基金募集

同本市场 ETF，跨市场 ETF 的募集采用现金方式。现金认购主要面向交易所场内投资者。现金认购以人民币办理，认购面值为每基金份额 1 元人民币，通过我所场内网上发售系统进行。

2.2.3 基金上市交易

可以在我所集中竞价交易平台和协议交易平台交易，交易规则和本市场 ETF 相同。

2.2.4 基金申购赎回

跨市场 ETF 在申购赎回时对所有成份股（含深市成份股，下同）采用现金替代，投资者付出（申购时）和获得（赎回时）现金，由基金公司代理买卖成份股。

由于所在市场不同，下文中资金交收周期（T+n）也不一定相同。下文只是以

恒指 ETF 为例说明跨市场 ETF 的申购赎回流程。如无特殊说明，文中日期指深交所交易日。

● 申购业务流程

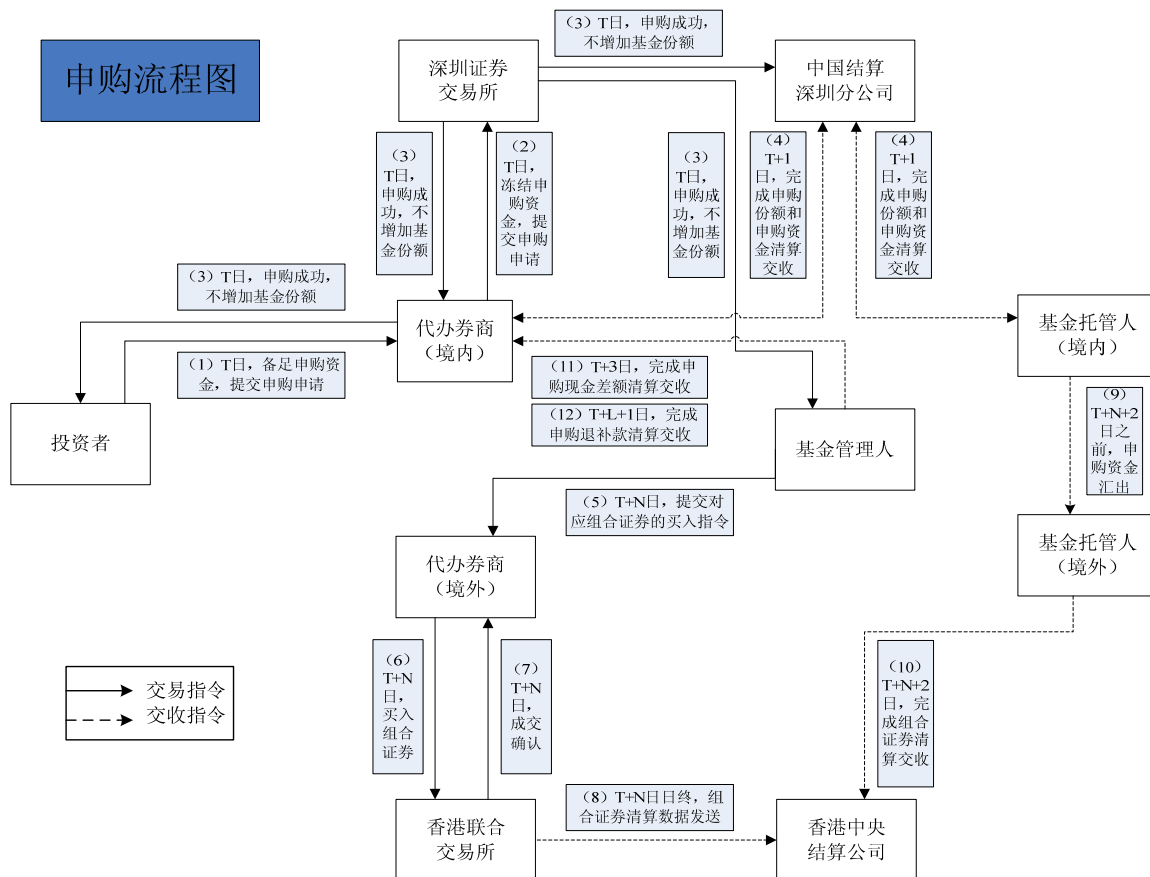


图 1 恒指 ETF 申购流程图

(1) T 日交易时间：投资者通过代办券商(境内)向深交所提出申购申请，代办券商(境内)冻结相应的现金。

(2) T 日交易时间：深交所不实时增加投资者的基金份额，并将投资者申购成交回报实时发送基金管理人、中国结算深圳分公司和代办券商。

(3) T 日收市后：中国结算深圳分公司根据交易所申购回报数据，进行申购资金及份额的清算，并将清算结果发送代办券商(境内)和基金管理人。

(4) T+1 日交收时点：中国结算深圳分公司进行申购资金及份额的逐笔全额非担保 DVP 交收，结算系统逐笔检查投资者用于申购的资金是否足额。资金足额的，根据基金管理人的委托，在基金托管人证券交收账户记增基金总份额，再将

基金份额划拨至代办券商（境内）的证券交收账户，并最终划拨至投资者的证券账户；同时将投资者用于申购的资金从代办券商（境内）资金交收账户划拨至基金托管人的资金交收账户。资金不足额的，视为交收失败，结算公司不办理相关份额和资金的交收。之后，中国结算深圳分公司将交收结果发送代办券商（境内）和基金管理人，交收成功的 ETF 申购份额 T+2 日可以卖出或赎回。

（5）T+N 日（N 由基金公司决定，指深交所和港交所的共同交易日）交易时间：基金管理人向代办券商（境外）发出买入组合证券的指令。

（6）T+N 日交易时间：代办券商（境外）及时完成买入组合证券的指令。

（7）T+N+2 日（2 指港交所的 2 个交易日）之前：申购资金到账后，基金管理人通过托管人（境内）完成换汇，并汇到在托管人（境外）开立的港币账户。

（8）T+N+2 日：基金管理人通过托管人（境外）完成组合证券及对应资金的清算交收。

（9）T+2 日，基金管理人向中国结算深圳分公司发送申购现金差额清算数据，中国结算深圳分公司将该数据转发给代办券商（境内）。

T+3 日交收时点，中国结算深圳分公司通过代收代付平台完成申购现金差额的交收。

（10）T+L 日（L 由基金公司根据申购组合证券代买完成日决定）：基金管理人将申购现金替代的多退少补清算数据发给中国结算深圳分公司，中国结算深圳分公司 T+L+1 日进行资金的代收代付。

● 赎回业务流程

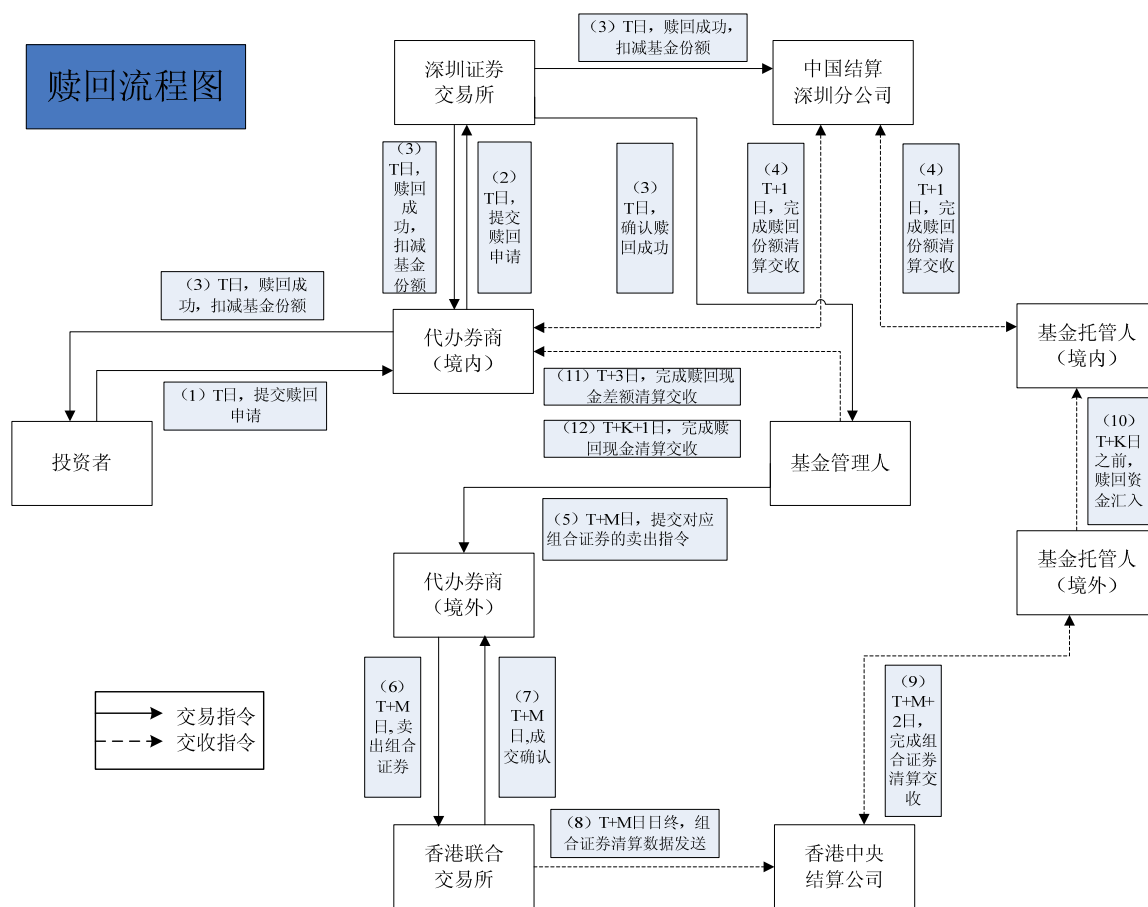


图 2 恒指 ETF 赎回流程图

(1) T 日交易时间：投资者通过代办券商(境内)向深交所提出赎回申请，代办券商(境内)冻结相应的基金份额。

(2) T 日交易时间：深交所实时扣减投资者的基金份额，并将投资者赎回成交回报实时发送基金管理人、中国结算深圳分公司和代办券商。

(3) T 日收市后：中国结算深圳分公司根据交易所赎回回报数据，进行赎回份额的清算，并将清算结果发送代办券商(境内)和基金管理人。

(4) T+1 日交收时点：**中国结算深圳分公司进行赎回份额的逐笔全额非担保交收**，结算系统逐笔检查投资者用于赎回的基金份额是否足额。份额足额的，将投资者用于赎回的基金份额根据代办券商(境内)的委托从投资者证券账户代为划拨到代办券商(境内)证券交收账户，再划拨到基金托管人证券交收账户后直接记减该份额。份额不足额的，视为交收失败，结算公司不办理相关份额的交收。之后，中国结算深圳分公司将交收结果发送代办券商(境内)和基金管理人。

(5) T+M 日(M 由基金公司决定，指深交所和港交所的共同交易日)交易时

间：基金管理人向代办券商(境外)发出卖出组合证券的指令。

(6) T+M 日交易时间：代办券商(境外)及时完成卖出组合证券的指令。

(7) T+M+2 (2 指港交所的 2 个交易日)：托管人(境外)完成组合证券及对应资金的清算交收。

(8) T+2 日：基金管理人向中国结算深圳分公司发送赎回现金差额清算数据，中国结算深圳分公司将该数据转发给代办券商(境内)。

T+3 日交收时点，中国结算深圳分公司通过代收代付平台完成赎回现金差额的交收。

(9) T+K 日(K 由基金公司根据组合证券代卖完成日决定)之前：组合证券卖出资金到账后，汇到在托管人(境内)开立的港币账户，通过托管人(境内)完成结汇。

(10) T+K 日：基金管理人将赎回现金清算数据发给中国结算深圳分公司，中国结算深圳分公司 T+K+1 日进行资金的代收代付。

2.2.5 基金份额参考净值(IOPV)揭示

深交所通过 SJSHQ.DBF 中的 HQSYL2 (市盈率 2) 发布 IOPV (每百份基金单位净值估值)，即 HQSYL2/100 的值为每份基金 IOPV 值，更新频率为每 15 秒一次。

三、跨市场 ETF 和本市场 ETF 的不同点

从上面的描述可以看出，跨市场 ETF 和本市场 ETF 的部分业务模式相同，主要的区别在于申购赎回处理的某些环节。

为便于在申购赎回时对跨市场 ETF 中的成份股进行现金替代，深交所新增虚拟成份股 159900 用于整体现金替代。对该虚拟成份股进行现金替代即相当于对所有成份股进行现金替代。为配合结算模式改造，我所在进行赎回的现金替代回报时，会将替代金额设置为 0。为控制风险，我所根据基金管理公司需求对当日申购、赎回规模进行控制。若当日申购或者赎回总量超过限制，当日不再允许进行申购赎回。

对跨市场 ETF 申购赎回，T 日(T 为申购委托日)中国结算深圳分公司发送清

算明细数据给相关结算参与人（通过 SJSQF.DBF 及 SJSQX1.DBF 接口），并发送汇总资金清算数据（通过 SJSQS.DBF 接口），T+1 日发送资金交收结果（通过 SJSQF.DBF 和 SJSJG.DBF 接口）。【注：对赎回，结算接口中包括份额数据，不包括赎回资金】

因为赎回时涉及境内外资金的划转，并且境外交易所的交收周期和国内交易所未必一致，为了控制结算风险，中国结算深圳分公司对赎回资金实行非担保交收。基金公司负责对赎回资金进行清算，T+K 日（T 为赎回委托日，K 由基金公司决定）中国结算深圳分公司接到基金公司指令后，转发明细赎回资金指令给券商（通过 SJSQF.DBF 及 SJSQX2.DBF 接口），同时体现在当日的资金清算数据（SJSQS.DBF）中，次结算日（T+K+1 日）完成资金的代收代付，若应付方资金不足，则代收代付失败。这些失败的指令，基金公司可以以后再次发给中国结算深圳分公司进行代收代付，中国结算深圳分公司再次转发明细赎回资金指令给券商。具体可参见相关业务文档。

表 1 跨市场 ETF 与本市场 ETF 的主要不同

项目名	跨市场 ETF	现有本市场 ETF
成份股构成	1. 包含非深市成份股，也可能包含深市成份股；	1. 都是深市成份股；
申购赎回申报	2.1 开放日为两个市场的共同交易日； 2.2 对所有成份股进行现金替代 2.3 使用 159900 对所有成份股进行现金替代，申购和赎回时的替代金额可以不同； 2.4 对申购、赎回规模进行控制；	2.1 开放日为本市场交易日； 2.2 对所有成份股进行股份联动监控（必须现金替代的成份股除外）； 2.3 可以对每一只成份股进行现金替代，申购和赎回时替代金额相同； 2.4 暂未对申购、赎回规模进行控制；
成交回报	3.1 可能有申购超限、赎回超限的回报记录； 3.2 会出现 159900 的资金替代明细记录； 3.3 发生现金替代时，赎回金额设置为 0，即 159900 的赎回替代金额为 0；	3.1 暂时没有申购超限、赎回超限的撤单回报记录； 3.2 不会出现 159900 的资金替代明细记录； 3.3 如果发生了现金替代，赎回金额不会为 0；
结算模式	4.1 对申购的份额和资金采取逐笔全额非担保 DVP 交收，对赎回份额采取逐笔全额非担保交收（非 DVP）、对赎回资金采取代收代付；	4.1 对申购赎回的份额和资金都采取担保交收；

项目名	跨市场 ETF	现有本市场 ETF
申购资金交收流程	<p>5.1 T 日 (T 为申购申请日) 中国结算深圳分公司根据深交所成交数据进行逐笔全额清算处理;</p> <p>5.2 T+1 日, 中国结算深圳分公司按逐笔全额非担保 DVP 交收模式完成资金和 ETF 份额交收;</p>	<p>5.1 按 T+1 DVP 担保交收模式完成申购资金和 ETF 份额交收;</p> <p>5.2 组合券 T 日过户;</p>
赎回资金交收流程	<p>6.1 T+K (T 为赎回申请日, K 由基金公司决定) 日, 基金公司将赎回资金指令发送中国结算深圳分公司;</p> <p>6.2 T+K+1 日, 中国结算深圳分公司进行赎回资金的代收代付;</p> <p>6.3 若代收代付不成功, 基金公司会再次将指令发送中国结算深圳分公司进行代收代付;</p> <p>6.4 不涉及组合券过户</p> <p>详参前述“申购业务流程”和“赎回业务流程”;</p>	<p>6.1 赎回资金采用 T+1 DVP 担保交收;</p> <p>6.2 组合券 T 日过户;</p>
PCF 文件内容	<p>6.1 “成份股信息”里包含虚拟成份股 159900, 非深市成份股;</p> <p>6.2 有“申购替代金额”和“赎回替代金额”两个字段, 分别表示必须现金替代的申购赎回替代金额, 值可以不同;</p> <p>6.3 有“挂牌市场”字段, 可以标识成份股挂牌市场;</p>	<p>6.1 “成份股信息”里都是深市成份股且不包含虚拟成份股 159900;</p> <p>6.2 只有“固定替代金额”, 表示必须现金替代的申购赎回替代金额;</p> <p>6.3 无“挂牌市场”字段;</p>

四、跨市场 ETF 的主要技术变更

4.1 申购赎回清单

为配合跨市场 ETF 业务, 申购赎回清单 (以下简称 PCF) 的格式和内容做了调整。新格式的 PCF 如下所示, 新增字段以红色字体标出。

4.1.1 参数部分字段定义

表 2 跨市场 ETF 的 PCF 参数定义

字段内容	格式	含义	范围
Version	C8	版本号	
FundID	C6	基金代码	[159901, 159999]
FundName	C30	基金名称	
FundManagementCompany	C30	基金公司名称	
UnderlyingIndex	C6	拟合指数代码	对我所分配了代码的指数，取值范围 [000000, 999999]。
CreationRedemptionUnit	C8	每个篮子（最小申购赎回单位）对应的 ETF 份数	[0, 99999999]
Estimatecashcomponent	C11	T 日每个篮子的预估现金差额，总长为 11 位（包括小数点），小数部分 2 位	[-9999999.99, 99999999.99]
MaxCashRatio	C7	最大现金替代比例，总长为 7 位（包括小数点），小数部分 5 位，例如：5.551% 在文件中用 0.05551 表示	[0.00001, 1]
Publish	C1	是否发布 IOPV, 0: 不发, 1: 发布	{0, 1}
Creation	C1	申购允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
Redemption	C1	赎回允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
CashCreation	C1	现金申购允许状态, 0: 禁止, 1: 允许	{0, 1}
RecordNum	C4	表示一个篮子中的深市成份股数目（包含 159900 证券）	[0, 9999]
TotalRecordNum	C4	表示一个篮子中的所有成份股数目（包含 159900 证券）	[0, 9999]
Type	C1	ETF 类型, 1: 本市场 ETF, 2: 跨市场 ETF	
TradingDay	C8	T 日日期，格式 YYYYMMDD	
PreTradingDay	C8	T-X 日日期，格式 YYYYMMDD, X 由基金公司根据基金估值时间确定	
CashComponent	C11	T-X 日申购赎回基准单位的现金余额，总长为 11 位（包括小数点），小数部分 2 位	[-9999999.99, 99999999.99]
NAVperCU	C12	T-X 日申购赎回基准单位净值，总长为 12 位（包括小数点），小数部分 2 位	[0, 999999999.99]

字段内容	格式	含义	范围
NAV	C8	T-X 日基金的单位净值。总长为 8 位 (包括小数点), 小数部分 4 位	[0, 999.9999]
DividendPerCU	C12	T 日申购赎回基准单位的红利金额, 总长为 12 位 (包括小数点), 小数部分 2 位	[0, 9999999999.99]
CreationLimit	C12	当天累计可申购的基金份额上限, 为 0 表示没有限制	[0, 999999999999]
Redemption Limit	C12	当天累计可赎回的基金份额上限, 为 0 表示没有限制	[0, 999999999999]

4.1.2 成份股部分字段定义

表 3 跨市场 ETF 的 PCF 中成份股参数定义

字段内容	格式	含义
证券代码	C6	关键字
证券简称	C8	四位中文, 左对齐, 右补空, 对正确性不校验
证券数量	C8	每个申购篮子中该成份股的数量, 数据右对齐, 左补空
替代标志	C1	表示该证券是否允许用现金进行替代。 0 表示禁止现金替代 (必须有证券), 1 表示可以进行现金替代 (先用证券, 证券不足的话用现金替代), 2 表示必须用现金替代
溢价比例	C7	证券用现金进行替代的时候, 计算价格时增加的比例 (不含 100%)。总长为 7 位 (包括小数点), 小数部分 5 位, 数据右对齐, 左补空, 小数必须为 5 位, 例如: 2.551 % 在文件中用 0.02551 表示; 2.1% 在文件中用 0.02100 表示。 此字段只有当替代标志为 '1' 时才使用
申购替代金额	C12	当某只证券必须用现金替代的时候, 申购时该证券所需总金额。 总长为 12 位 (包括小数点), 小数部分 3 位 数据右对齐, 左补空, 小数必须为 3 位, 例如: 2000 在文件中用 2000.000 表示 此字段只有当替代标志为 '2' 时才使用
赎回替代金额	C12	当某只证券必须用现金替代的时候, 赎回时对应该证券

字段内容	格式	含义
		<p>返还的总金额。</p> <p>总长为 12 位（包括小数点），小数部分 3 位</p> <p>数据右对齐，左补空，小数必须为 3 位，例如：2000 在文件中用 2000.000 表示。对于跨市场 ETF，该字段为 0.000</p> <p>此字段只有当替代标志为‘2’时才使用</p>
挂牌市场	C8	成份股挂牌市场，市场代码采取 ISO10383 标准，XSHE-深圳市场，XSHG-上海市场，XHKG-香港市场.....

4.1.3 成份股信息

在 PCF “成份股信息” 会增加虚拟成份股 159900 的信息，该虚拟成份股的“替代标志” 字段为 “必须现金替代”，“挂牌市场” 字段为 “XSHE”，表示该虚拟成份股是深市成份股，在申购赎回时，对该虚拟成份股必须使用现金替代。

在 PCF 里，通常是深市成份股信息排列在前面，其后是非深市成份股。成份股主要揭示给投资者进行申购赎回时参考用。

4.1.4 关于旧格式的 PCF

为减少对从事本市场 ETF 的 PD 券商和基金公司的影响，将会继续保留旧格式的 PCF。从事跨市场 ETF 的 PD 券商和基金公司需要使用新格式的 PCF，从事本市场 ETF 的 PD 券商和基金公司可以继续使用旧格式的 PCF，也可以选择使用新格式的 PCF。未来的趋势是统一 PCF 格式，即今后新发的 ETF 无论是跨市场 ETF 或者本市场 ETF，都将尽量使用新格式的 PCF。

新 PCF 格式完全兼容旧格式。如新格式 PCF 应用于本市场 ETF 业务，“成份股信息” 里不能包含 159900 的信息，并且 PCF 中的 “RecordNum” 和 “TotalRecordNum” 会设置为相等，“Type” 设置为 “1”，“CreationLimit” 和 “RedemptionLimit” 设置为 0，“申购替代金额” 和 “赎回替代金额” 设置为相等，成份股 “挂牌市场” 都设置为 “XSHE”。

4.2 深交所数据接口规范的调整

为配合跨市场 ETF 业务，深交所和中国结算深圳分公司调整了数据接口规范，主要有：

- 证券信息库 SJSXX.DBF 和新证券信息库 SJSXXN.DBF

若本所未分配跨市场 ETF 跟踪的指数代码，则新证券信息库 SJSXXN.DBF 相应 ETF 记录的 XXJCZQ 字段设置为 0。

通过 SJSXX.DBF 和 SJSXXN.DBF 发布虚拟成份股 159900 的信息，该证券仅限于在申购赎回时用于对跨市场 ETF 中一揽子成份股进行现金替代，不能用于其他业务。该证券的 XXZQJC 字段值为“申赎现金”，XXZQJB 字段值为‘0’（净值揭示服务开放式基金）。

- 成交回报库 SJSHB.DBF

当发生跨市场 ETF 申购业务时，SJSHB.DBF 会出现证券代码为 159900 的回报记录：HBYWLB 字段为“ZB”，HBCJSL 字段存放“篮子数量”，HBCJJB 字段存放“替代金额”。如果 159900 对应的申购替代金额太大，可能拆分资金替代明细的回报记录。为了尽可能避免拆分记录，若替代金额的第三位小数为 0，则将 HBCJSL 字段设置为“10 * 篮子数量”，而替代金额则除以 10，使得“成交数量 * 成交价格”保持为该笔申购所对应的实际替代金额；然后再判断是否拆分。（参见针对本市场 ETF 业务的《深圳证券交易所 ETF 业务券商技术系统变更指南》6.3.1.3 相关内容）

当发生跨市场 ETF 赎回业务时，SJSHB.DBF 也会出现证券代码为 159900 的回报记录：HBYWLB 字段为“ZS”，HBCJSL 字段存放“篮子数量”，HBCJJB 字段设置为 0。按照替代金额=“成交数量”×“成交价格”计算，替代金额为 0，表示赎回时成份股的现金替代金额为 0。

在 SJSHB.DBF 库中新增了“申购超限”和“赎回超限”两类回报。

- 股份结算信息库 SJSGF.DBF

增加‘L9’业务，表示跨市场 ETF 赎回资金，增加‘LA’、‘LC’业务，分别表示申购份额和资金清算交收数据、赎回份额清算交收数据，具体定义请参见附件二。

- 资金清算库 SJSQS.DBF

增加‘L9’业务，表示跨市场 ETF 赎回资金，增加 LA、LB、LD 三类业务，分别表示非担保交收方式的 ETF 申购资金、申购税费和赎回税费。具体定义如下表所示：

表 4 清算业务含义表（见数据接口规范表 4-1）

QSYWLB	相应业务含义	说明
L9	跨市场 ETF 赎回资金	QSZQDH 为 ETF 证券代码 成交日期为空，清算日期为当日，交收日期=清算日期+1。 卖出金额表示赎回资金。
LA	ETF 申购 (针对“通过深交所进行申购赎回的跨市场 ETF”，非担保交收方式)	QSZQDH 为 ETF 证券代码。 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。 买入金额表示现金替代资金。QSBYZ1 左起第一位为‘N’。
LB	ETF 申购税费 (针对“通过深交所进行申购赎回的跨市场 ETF”)	成交日期=清算日期-1，交收日期=清算日期+1。 本记录为 T-1 交易日申购业务相关的税费（T 为当前交易日）。QSBYZ1 左起第一位设为‘Y’。
LD	ETF 赎回税费 (针对“通过深交所进行申购赎回的跨市场 ETF”)	QSZQDH 为 ETF 证券代码。 成交日期=清算日期-1，交收日期=清算日期+1。 本记录为 T-1 交易日赎回业务相关的税费（T 为当前交易日）。QSBYZ1 左起第一位设为‘Y’。

备注：

上表中 L9、LA、LB、LD 的业务说明是从券商角度说的，对基金公司来说，上表“说明”一列中，“买入金额”定义的内容，体现在“卖出金额”中，“卖出金额”定义的内容，体现在“买入金额”中。

● 资金结算信息库 SJSZJ.DBF

增加用途代号 C009、C013：

表 5 用途代号含义表（见数据接口规范表 4-2）

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
C009	跨市场 ETF 赎回资金	证券代码

ZJYTDH	资金用途描述	ZJZQDM
C009	跨市场 ETF 赎回资金	证券代码
C013	ETF 申购现金替代资金（非担保交收）	证券代码

关于 ETF 资金代收代付方面的接口规范，以前曾经发布，现已体现在《深圳证券交易所数据接口规范（Ver4.60）.doc（未启用）》中。

4.3 结算参与人接口规范的调整

● 启用 SJSMX1.DBF

内含 T 日跨市场 ETF 申购、赎回清算明细记录（非担保交收方式）以及税费清算明细记录（担保交收方式），业务类别分别为 LA、LB、LC、LD。SJSMX1.DBF 的结构及填写说明请见附件三。

● 启用 SJSMX2.DBF

内含代收代付业务的清算明细记录（非担保交收方式），业务类别包括 L6、L7、L8、L9。SJSMX2.DBF 的结构及填写说明请见附件三相关章节。

● 启用 SJSJG.DBF

内含上一工作日 SJSMX1.DBF 及 SJSMX2.DBF 中清算数据对应的明细交收结果。具体请参见附件四【注：SJSMXn.DBF 及 SJSJG.DBF 之前已通过 TS(1)-2010-0002 中国结算深圳分公司结算参与人数据接口规范（Ver1.3 未启用）对外公布，请参见 www.chinaclear.cn 技术专区/深圳市场/数据接口规范栏目。】

● 跨市场 ETF 资金代收代付是否成功的判断方法

券商可根据自身具体情况，选择从 SJSMX2.DBF 接收清算明细并根据 SJSJG.DBF 直接判断清算明细数据是否交收成功，或者仍选择从 SJSJG.DBF 接收清算明细数据并采用 SJSZJ.DBF 和 SJSJG.DBF 相结合的方法判断交收是否成功【具体请参见《深圳证券交易所数据接口规范（Ver4.60 未启用）》中 SJSJG.DBF 一节中业务类别含义表（表 3-1）后的备注部分】。二者只能选其一，不能同时选择。

● 跨市场 ETF 申购赎回交收是否成功的判断方法

对于券商，可选择通过 SJSMX1.DBF 接收 ETF 申购赎回清算明细、通过

SJSJG.DBF 接收 ETF 申购赎回明细交收结果;也可选择通过 SJSGF.DBF 接收 ETF 申购赎回清算明细和交收结果;二者只能选其一。

对于基金管理公司,只能通过 SJSXM1.DBF 接收 ETF 申购赎回清算明细,通过 SJSJG.DBF 接收 ETF 申购赎回明细交收结果。

4.4 基金管理人接口规范的调整

修订了中国结算深圳分公司和基金管理公司之间的数据接口,在 GLRQS.DBF 和 GLRFK.DBF 中增加了‘L9’业务,表述跨市场 ETF 赎回资金,具体请参见:

《TS(1)-2009-0001 基金管理人登记结算数据接口规范(Ver 1.1 讨论稿).doc》

五、 券商系统支持跨市场 ETF 业务的注意事项

从事跨市场 ETF 的 PD 券商的柜台系统需要支持新格式的 PCF。如果某会员同时是跨市场 ETF 和本市场 ETF 的 PD 券商,其柜台系统需要支持新旧格式的 PCF。

由于申购采用非担保结算,当日申购份额当日不能卖出,券商系统在收到申购成交回报后,不能记增投资者的基金份额。

中国结算深圳分公司对跨市场 ETF 赎回资金采取非担保交收,PD 券商不应再对赎回资金进行预清算,并且注意在 T+K 日接受中国结算深圳分公司转发的赎回资金清算数据,在 T+K+1 日办理赎回资金代收代付。具体清算数据发送和赎回资金划付的时间取决于基金公司。

六、 附件一: 恒指 ETF 申购赎回清单

(仅做示意,实际数据以基金公司到时发布为准)

[ETFHZ]

Version=2.0

FundID=159917

FundName=恒指 ETF

FundManagementCompany=华夏基金管理有限公司

UnderlyingIndex=HSI

CreationRedemptionUnit=2000000

EstimateCashComponent=-8331.22

MaxCashRatio=1.00000

Publish=1

Creation=1

Redemption=1

CashCreation=0

RecordNum=1

TotalRecordNum=43

Type=2

TradingDay=20111014

PreTradingDay=20111013

CashComponent=-3607.01

NAVperCU=3583289.27

NAV=1.792

DividendPerCU=0.00

CreationLimit=500000000000

RedemptionLimit=500000000000

TAGTAG

159900	申赎现金	2		3950728.550		0.000	XSHE	
00001	长江实业	8300	1 0.10000				XHKG	
00002	中电控股	25900	1 0.10000				XHKG	
00003	中华煤气	1200	1 0.10000				XHKG	
00004	九龙仓	2900	1 0.10000				XHKG	
00005	汇丰控股	1500	1 0.10000				XHKG	
00006	香港电灯	2100	1 0.10000				XHKG	
00011	恒生银行	1900	1 0.10000				XHKG	
00012	恒基地产	2900	1 0.10000				XHKG	

00013	和记黄埔	2600	1 0.10000		XHKG
00016	新鸿基	1400	1 0.10000		XHKG
00017	新世界	1900	1 0.10000		XHKG
00019	太古股份	2000	1 0.10000		XHKG
00023	东亚银行	1500	1 0.10000		XHKG
00066	港铁公司	2700	1 0.10000		XHKG
00083	信和置业	4100	1 0.10000		XHKG
00101	恒隆地产	2100	1 0.10000		XHKG
00144	招商局	6400	1 0.10000		XHKG
00267	中信泰富	2600	1 0.10000		XHKG
00291	华润创业	2500	1 0.10000		XHKG
00293	国泰航空	900	1 0.10000		XHKG
00330	思捷环球	900	1 0.10000		XHKG
00386	中石化	1200	1 0.10000		XHKG
00388	港交所	5900	1 0.10000		XHKG
00494	利丰	1500	1 0.10000		XHKG
00551	裕元集团	1600	1 0.10000		XHKG
00688	中国海外	1100	1 0.10000		XHKG
00700	腾讯控股	2600	1 0.10000		XHKG
00762	中国联通	1800	1 0.10000		XHKG
00857	中国石油	3000	1 0.10000		XHKG
00883	中海洋	3600	1 0.10000		XHKG
00939	建设银行	1300	1 0.10000		XHKG
00941	中国移动	900	1 0.10000		XHKG
01088	中国神华	600	1 0.10000		XHKG
01199	中远	2200	1 0.10000		XHKG
01398	工商银行	1700	1 0.10000		XHKG
02038	富士康	1600	1 0.10000		XHKG
02318	中国平安	2100	1 0.10000		XHKG

02388	中银香港	1100	1	0.10000				XHKG	
02600	中国铝业	900	1	0.10000				XHKG	
02628	中国人寿	1600	1	0.10000				XHKG	
03328	交通银行	2100	1	0.10000				XHKG	
03988	中国银行	6300	1	0.10000				XHKG	

ENDENDEND

七、附件二：SJS GF.DBF 中新增业务详细描述

表 6 业务类别含义表（见数据接口规范表 3-1）

GFYWLB	相应业务含义	GFQRGS			GFZJJE		
L9	跨市场 ETF 的赎回资金，投资者应收资金（GFZJJE>0） GFZQDM 为跨市场 ETF 证券代码。 GFSFZH 第 1~8 位表示委托日期，格式是 CCYYMMDD，第 9~17 位表示委托当日的成交号码。		=0		投资者应 收资金	>0	N (请见 备注)
LA	1. “通过深交所交易系统进行申购赎回的跨市场 ETF” T 日申购业务（非担保交收模式）的清算明细数据。 GFSFZH 左起第 1~8 位表示委托日期，格式是 CCYYMMDD，和 GFFSRQ 为同一天；第 9~17 位表示委托当日的成交号码	应收 ETF 份 额 (GFQRGS 和 GFZJJE 不同 时为 0)	≥0	N	应付全额 现金替代 资金	≤0	N
	2. “通过深交所交易系统进行申购赎回的跨市场 ETF” T-1 日申购的明细交收结果数据。GFSFZH 左起第 1~8 位表示委托日期，格式是 CCYYMMDD，为 GFFSRQ 的前一工作日；第 9~17 位表示委托当日的成交号码。若交收失败，则 GFCWDH 非空。	应收 ETF 份 额 (GFQRGS 和 GFZJJE 不同 时为 0)	≥0	Y	应付全额 现金替代 资金	≤0	Y
LC	1. “通过深交所交易系统进行申购赎回的跨市场 ETF” T 日赎回业务（非担保交收模式）的清算明细数据。 GFSFZH 左起第 1~8 位表示委托日期，格式是 CCYYMMDD，和 GFFSRQ 为同一天；第 9~17 位表示委	应付 ETF 份 额	<0	N		=0	N

GFYWLB	相应业务含义	GFQRGS			GFZJJE		
	托当日的成交号码						
	2. “通过深交所交易系统进行申购赎回的跨市场 ETF” T-1 日赎回的明细交收结果数据。GFSFZH 左起第 1~8 位表示委托日期, 格式是 CCYYMMDD, 为 GFFSRQ 的前一工作日; 第 9~17 位表示委托当日的成交号码。若交收失败, 则 GFCWDH 非空。	应付 ETF 份额	<0	Y		=0	N

备注:

券商 T 日收到某基金的 ‘L9’ 明细指令后, 不记投资者账;

待 T+1 日收到 SJSZJ.DBF 数据后, 判断其中是否存在 “用途代号” 为 C009、“发生证券代码” 为该基金代码的资金交收记录, 若有, 则表示 T 日该批 ‘L9’ 明细指令交收成功, 请记投资者账, 若无, 则表示 T 日该批 ‘L9’ 明细指令交收失败, 不记投资者账。

对于交收失败的指令, 基金公司日后会再次发给中国结算深圳分公司, 中国结算深圳分公司在接收当日, 会再次通过 ‘L9’ 业务转发给相关券商。

八、附件三：SJSMXn.DBF 定义及填写说明 (n 为整数数字，表示批次)

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	MXJSZH	结算账户	C	6	
2	MXBFZH	备付金账户	C	10	
3	MXSJLX	数据类型	C	2	
4	MXYWLB	业务类别	C	2	
5	MXZQDM	证券代码	C	6	
6	MXJYXW	交易单元	C	6	
7	MXXWDM	托管单元	C	6	
8	MXGDDM	股东代码	C	10	
9	MXWTXH	委托序号/申请单号	C	24	
10	MXCJHM	成交号码	C	8	
11	MXQSLS	清算流水号	C	12	
12	MXCJSL	成交数量	N	12, 0	
13	MXQSSL	清算数量	N	12, 0	
14	MXCJJG	成交价格	N	15, 9	
15	MXQSJG	清算价格	N	15, 9	
16	MXXYJY	信用交易标识	C	1	
17	MXPCBS	平仓标识	C	1	
18	MXZQLB	证券类别	C	2	
19	MXGFXZ	股份性质	C	2	
20	MXJSFS	交收方式	C	1	
21	MXHBDH	货币代号	C	3	
22	MXQSBJ	清算本金	N	17, 2	
23	MXYHS	印花税	N	12, 2	
24	MXJYF	交易经手费	N	12, 2	
25	MXJGGF	监管规费	N	12, 2	
26	MXGHF	过户费	N	12, 2	
27	MXJSF	结算费	N	12, 2	
28	MXSXF	手续费	N	12, 2	
29	MXQSYJ	券商佣金	N	12, 2	券商系统自用
30	MXQTFY	其他费用	N	12, 2	
31	MXZJJE	资金金额	N	17, 2	
32	MXSFJE	收付净额	N	18, 2	
33	MXCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
34	MXQSRQ	清算日期	D	8	CCYYMMDD
35	MXJSRQ	交收日期	D	8	CCYYMMDD
36	MXFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
37	MXSCDM	市场代码	C	2	
38	MXJYFS	交易方式	C	2	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
39	MXZQDM2	证券代码 2	C	6	
40	MXPPHM	匹配号码	C	10	
41	MXBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库用于向结算参与人发送明细清算数据(将分多批次发送,文件名 SJSMXn.DBF 中的 n 为批次号),数据明细至投资者的每一笔委托。结算参与人可根据自身需要,从多个角度对清算明细数据进行汇总和处理。

(2) MXJSZH(字段 1: 结算账户),是托管单元(字段 7: MXXWDM)所属的结算账户。

(3) MXSJLX(字段 3: 数据类型),‘01’: 清算明细,‘02’: 通知类数据。

(4) MXYWLB(字段 4: 业务类别),业务类别代码。每种业务类别的含义参见下文业务类别含义表。

(5) MXWTXH(字段 9: 委托序号/申请单号),业务申报时的委托序号或申请单编号,左对齐,右补空格。

(6) MXCJHM(字段 10: 成交号码),深交所对业务委托进行回报时生成的成交号码,对于其它渠道申报的业务委托,成交号码可能为空。

(7) MXQSLS(字段 11: 清算流水号),结算机构生成的清算流水号码,左对齐,右补空格。

(8) MXQSSL(字段 13: 清算数量),正数表示结算参与人应收数量;负数表示结算参与人应付数量。

(9) MXXYJY(字段 16: 信用交易标识),‘1’: 融资,‘2’: 融券,‘ ’: 其它。

(10) MXPCBS(字段 17: 平仓标识),‘1’: 开仓,‘2’: 平仓,‘3’: 强制平仓,‘ ’: 其它。

(11) MXZQLB(字段 18: 证券类别),请参见证券类别含义表。

(12) MXGFXZ(字段 19: 股份性质),结算公司保留字段。

(13) MXJSFS(字段 20: 交收方式),表示该类业务的交收方式。‘Y’: 担保净额 DVP 交收;‘N’: 非担保交收;‘A’: 担保净额非 DVP 交收;‘ ’: 其它。

(14) MXHBDH(字段 21: 货币代号),‘RMB’: 人民币;‘HKD’: 港币;‘USD’: 美元。

(15) MXQSBJ(字段 22: 清算本金),表示该笔业务委托的清算本金,不含税费。正数表示结算参与人应收金额,负数表示结算参与人应付金额。

(16) MXYHS、MXJYF、MXJGGF、MXGHF、MXJSF、MXSXF(字段 23~28)表

示各类税费，正数表示结算参与人应收金额，负数表示结算参与人应付金额。

(17) MXSFJE (字段 32: 收付净额), 一般情况下
 $MXSFJE=MXQSZJ+MXYHS+MXJYF+MXJGGF+MXGHF+MXJSF+MXSXF+MXQTFY+MXZJJE$,
 特殊情况参见具体业务定义。

(18) MXSCDM (字段 37: 市场代码), 结算公司保留字段。

(19) MXJYFS (字段 38: 交易方式), 表示业务委托的交易方式或渠道。
 ‘01’: 普通交易(经深交所), ‘02’: 大宗交易(经深交所), ‘03’: 经深交所
 申报的非交易业务, ‘04’: 经中国结算深圳分公司 D-COM 系统申报的非交易
 业务, ‘05’: 经中国结算总公司基金业务平台申报的业务, ‘06’: 经中国结
 算总公司 TA 系统申报的业务, ‘07’: 经其它渠道申报的业务, ‘08’: 中国结
 算深圳分公司前台业务, ‘09’: 中国结算深圳分公司特殊处理, ‘ ’: 其它。

(20) MXPPHM (字段 40: 匹配号码), 用于匹配 SJSMXn.DBF 和
 SJSMXFZn.DBF 中数据。如果当前业务尚有辅助信息在 SJSMXFZn.DBF 中 (也即
 对于当前业务, SJSMXn.DBF 中放不下所有信息, 有一部分信息放在
 SJSMXFZn.DBF 中), 则此字段非空 (由结算公司生成, 同一发送日期内匹配号
 码不重复, SJSMXn.DBF 和 SJSMXFZn.DBF 中具有相同发送日期和匹配号码的属
 于同一条业务记录), 否则此字段为空。

业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
L6	ETF 申购现金替代-代收付
L7	ETF 申购赎回现金差额
L8	ETF 申购赎回现金替代多退少补
L9	ETF 赎回现金替代-代收付
LA	ETF 申购份额及资金(逐笔全额非担保 DVP 模式)
LB	ETF 申购税费
LC	ETF 赎回份额(逐笔全额非担保非 DVP 模式)
LD	ETF 赎回税费

注: 上表中 L6 业务是针对跨沪深市场 ETF 引入的。

对于跨市场 ETF 申购赎回, 通过 SJSMX1.DBF 和 SJSJG.DBF (定义见下文附件四) 向结算
 参与人发送清算明细和明细交收结果。SJSMX1.DBF 的数据填写说明如下: (√表示正常填写,
 空白表示此字段不填)

字段名	业务类别				
	LA (ETF 申购, 份额)	LA (ETF 申购, 资金)	LB (ETF 申 购税费)	LC (ETF 赎回, 份 额)	LD (ETF 赎回税 费)
MXJSZH	✓	✓	✓	✓	✓
MXBFZH	✓	✓	✓	✓	✓
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWL	‘LA’	‘LA’	‘LB’	‘LC’	‘LD’
MXZQDM	基金代码	基金代码	基金代码	基金代码	基金代码
MXJYXW	✓	✓	✓	✓	✓
MXXWDM	✓	✓	✓	✓	✓
MXGDDM	✓	✓	✓	✓	✓
MXWTXH	✓	✓	✓	✓	✓
MXCJHM	✓	✓	✓	✓	✓
MXQSLS					
MXCJSL	✓ 正数			✓ 负数	
MXQSSL	✓ 正数			✓ 负数	
MXCJJG					
MXQSJG					
MXXYJY					
MXPCBS					
MXZQLB					
MXGFXZ					
MXJSFS	‘N’	‘N’	‘Y’	‘N’	‘Y’
MXHBDH		✓	✓		✓
MXQSB		负数, 应付 申购现金替 代资金			
MXYHS			✓ ≤0		✓ ≤0
MXJYF			✓ ≤0 申购经手 费		✓ ≤0 赎回经手费
MXJGGF			✓ ≤0		✓ ≤0
MXGHF					
MXJSF			✓ ≤0 申购结 算 风险金		✓ ≤0 赎回结 算风 险金

字段名	业务类别				
	LA (ETF 申购, 份额)	LA (ETF 申购, 资金)	LB (ETF 申 购税费)	LC (ETF 赎回, 份 额)	LD (ETF 赎回税 费)
MXSXF					
MXQSYJ					
MXQTFY					
MXZJJE					
MXSFJE					
MXCJRQ	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T-1 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T-1 日
MXQSRQ	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日
MXJSRQ	✓ 为 T+1 日	✓ 为 T+1 日	✓ 为 T+1 日	✓ 为 T+1 日	✓ 为 T+1 日
MXFSRQ	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日	✓ 为 T 日
MXSCDM					
MXJYFS	✓ '01'	✓ '01'	✓ '01'	✓ '01'	✓ '01'
MXZQDM2					
MXPPHM					
MXBYBZ					

注意：上表中业务说明是从券商角度来讲的，对于基金公司来讲，LA、LC 业务的 MXCJSL、MXQSSL、MXQSBJ 几个字段值的正负号与上表中的定义相反。

另外，此类 ETF 是否征收相关税费，要看具体的业务通知，此处只是预留 LB、LD 两类数据接口，若不收费，则 SJSMX1.DBF 中将没有 LB、LD 业务的记录。

对于 ETF 代收代付业务，采用非担保交收方式，将通过 SJSMX2.DBF 和 SJSJG.DBF 向券商发送清算明细和明细交收结果。SJSMX2.DBF 的数据填写说明如下：（✓表示正常填写，空白表示此字段不填）

字段名	业务类别			
	L6	L7	L8	L9
MXJSZH	✓	✓	✓	✓
MXBFZH	✓	✓	✓	✓
MXSJLX	'01'	'01'	'01'	'01'

字段名	业务类别			
	L6	L7	L8	L9
MXYWLB	‘L6’	‘L7’	‘L8’	‘L9’
MXZQDM	基金代码	基金代码	基金代码	基金代码
MXJYXW	✓	✓	✓	✓
MXXWDM	✓	✓	✓	✓
MXGDDM	✓	✓	✓	✓
MXWTXH	✓	✓	✓	✓
MXCJHM		是否为空视 申报渠道而 定	是否为空视 申报渠道而 定	是否为空视 申报渠道而 定
MXQSLS				
MXCJSL				
MXQSSL				
MXCJJG				
MXQSJG				
MXXYJY				
MXPCBS				
MXZQLB				
MXGFXZ				
MXJSFS	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’
MXHBDH	✓	✓	✓	✓
MXQSBJ	负数, 应付申 购现金替代	正数表示应 收现金差额 负数表示应 付现金差额	正数表示应 收退款 负数表示应 付补款	正数, 应收赎 回现金替代
MXYHS				
MXJYF				
MXJGGF				
MXGHF				
MXJSF				
MXSXF				
MXQSYJ				
MXQTFY				
MXZJJE				
MXSFJE				

字段名	业务类别			
	L6	L7	L8	L9
MXCJRQ	✓	✓	✓	✓
MXQSRQ	✓	✓	✓	✓
MXJSRQ	✓	✓	✓	✓
MXFSRQ	✓	✓	✓	✓
MXSCDM				
MXJYFS	✓	✓	✓	✓
MXZQDM2	组合券代码(若基金公司不提供,可能为空)		组合券代码	组合券代码(若基金公司不提供,可能为空)
MXPPHM				
MXBYBZ				

九、附件四：明细交收结果 SJSJG.DBF 定义及填写说明

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JGJSZH	结算账户	C	6	
2	JGBFZH	备付金账户	C	10	
3	JGSJLX	数据类型	C	2	
4	JGYWLB	业务类别	C	2	
5	JGZQDM	证券代码	C	6	
6	JGJYXW	交易单元	C	6	
7	JGXWDM	托管单元	C	6	
8	JGGDDM	股东代码	C	10	
9	JGWTXH	委托序号/申请单号	C	24	
10	JGCJHM	成交号码	C	8	
11	JGQSLS	清算流水号	C	12	
12	JGCJSL	成交数量	N	12,0	
13	JGQSSL	清算数量	N	12,0	
14	JGJSSL	交收数量	N	12,0	
15	JGCJJG	成交价格	N	15,9	
16	JGQSJG	清算价格	N	15,9	
17	JGXYJY	信用交易标识	C	1	
18	JGPCBS	平仓标识	C	1	
19	JGZQLB	证券类别	C	2	
20	JGAFXZ	股份性质	C	2	

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
21	JGJSFS	交收方式	C	1	
22	JGHBDH	货币代号	C	3	
23	JGQSBJ	清算本金	N	17, 2	
24	JGYHS	印花税	N	12, 2	
25	JGJYF	交易经手费	N	12, 2	
26	JGJGGF	监管规费	N	12, 2	
27	JGGHF	过户费	N	12, 2	
28	JGJSF	结算费	N	12, 2	
29	JGSXF	手续费	N	12, 2	
30	JGQSYJ	券商佣金	N	12, 2	券商系统自用
31	JGQTFY	其它费用	N	12, 2	
32	JGZJJE	资金金额	N	17, 2	
33	JGSFJE	收付净额	N	18, 2	
34	JGJSBZ	交收标志	C	1	
35	JGZYDH	摘要代号	C	3	
36	JGCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
37	JGQSRQ	清算日期	D	8	CCYYMMDD
38	JGJSRQ	交收日期	D	8	CCYYMMDD
39	JGFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
40	JGSCDM	市场代码	C	2	
41	JGJYFS	交易方式	C	2	
42	JGZQDM2	证券代码 2	C	6	
43	JGBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库用于向结算参与人发送交收结果明细, 内含对 SJSMXn.DBF 中清算明细的逐笔交收结果 (要参见具体业务定义), 券商可根据自身需要, 根据交收结果进行相关交收处理。

(2) JGSJLX (字段 3: 数据类型), '01': 交收结果明细。

(3) JGJSSL: (字段 14: 交收数量), 实际交收的股份数量, 正数表示结算参与人收到的数量; 负数表示结算参与人付出的数量。全部交收成功时等于 JSQSGS。

(4) JGSFJE (字段 33: 收付净额), 一般情况下 $JGSFJE = JGJSZJ + JGYHS + JGJYF + JGJGGF + JGGHF + JGJSF + JGSXF + JGQTFY + JGZJJE$, 特殊情况参见具体业务定义。

(5) JGJSBZ: (字段 34: 交收标志), 'Y': 交收成功; 'N': 交收失败

(6) JGZYDH: (字段 35: 摘要代号), 交收成功时为空, 交收失败时为失败原因代码, 具体定义请参见《深圳证券交易所数据接口规范 (Ver4.60 未启用)》中错误代码含义表 (表 6-4)。

其它各字段含义参照 SJSMXn.dbf 中“字段描述”相同的字段。

针对上文 SJSMX1.DBF 中 T 日申购、赎回清算明细数据, SJSJG.DBF 中仅含 LA、LC 业务的逐笔交收结果, 填写说明如下: (✓表示会填写数据)

字段名	业务类别		
	LA (ETF 申购, 份额)	LA (ETF 申购, 资金)	LC (ETF 赎回, 份额)
JGJSSL	✓ (交收失败则为 0; 交收成功则 =SJSMX1.DBF 中 MXQSSL)		✓ (交收失败则为 0; 交收成功则 =SJSMX1.DBF 中 MXQSSL)
JGJSBZ	✓ 交收成功则为 'Y', 交收失败则为 'N'	✓ 交收成功则为 'Y', 交收失败则为 'N'	✓ 交收成功则为 'Y', 交收失败则为 'N'
JGZYDH	✓ 交收成功时为空, 交收失败时为失败原因代码	✓ 交收成功时为空, 交收失败时为失败原因代码	✓ 交收成功时为空, 交收失败时为失败原因代码