

深市 ETF 交易结算模式调整技术变更指南

一. 说明

为方便市场参与各方更好地完成“深市 ETF 交易结算模式调整”相关技术准备工作，深圳证券交易所（以下简称“深交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）深圳分公司制定本文档，供交易参与人和结算参与人及其 IT 供应商变更技术系统时参考。

二. 业务简介

2.1 深市 ETF 交易申赎业务所涉及的担保结算模式调整

深市 ETF 现行 T+1 担保 DVP 结算模式调整为 A 股交收模式，所涉及业务范围包括：深市所有 ETF 品种的交易业务及深市单市场 ETF、货币 ETF 及实物债券 ETF 品种的申购赎回业务。

2.2 深市 ETF 申赎业务所涉及的非担保结算模式调整

现金债券 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF，赎回份额注销时点从 T+1 日日终调整为 T 日日终。

以全额现金申购的现金债券 ETF，从现行 T+1 日日终逐笔全额非担保交收结算模式，调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收结算模式；以全额现金申购的黄金 ETF，从现行的 T 日日终逐笔全额非担保交收结算模式，调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收结算模式。

2.3 深市 ETF 除权除息日调整

深市所有 ETF 品种的除权除息日，从 ETF 份额权益登记日（R 日）当天，调整为 ETF 份额权益登记日次一交易日（R+1 日）。

2.4 深市跨市场 ETF 新增场内申赎担保结算模式

深市跨市场 ETF 取消原有场内全额现金申赎模式，新增“场内部分实物、部分现金”申赎模式。深市组合券采用实物交收，非深市组合券采用全现金（替代）交收。新申赎模式下，对于深市组合券及深市现金替代部分，深市组合券 T 日

日终过户，深市现金替代部分采用净额担保交收；对于非深市组合券所对应的现金替代部分采用净额担保交收。申赎份额于 T 日日终完成登记和注销；现金差额、现金替代退补款部分采用代收代付方式。跨市场 ETF 新申赎模式实施的净额担保交收，比照单市场 ETF 申赎，均为 A 股交收模式。

2.5 深市 ETF 其他相关业务的调整

深市 ETF 调整为 A 股交收模式后，ETF 份额 T 日日终即完成交收，不再维护在途 ETF 份额的可用额度，债券 ETF 的质押式回购业务、ETF 融资融券业务将参照现有 A 股交收模式进行。

2.6 深市 ETF 交易申赎份额使用规则的调整

对于黄金 ETF，T 日买入的 ETF 份额，T 日可以现金赎回，T+1 日可以实物赎回。

对于跨市场股票 ETF，其 ETF 份额和深市组合证券的场内申赎股份使用规则与本市场股票 ETF 类似：

T 日买入的 ETF 份额，T 日可用于场内赎回，T 日可用于场外赎回；

T 日买入的深市组合证券，T 日可用于场内申购，T 日可用于场外申购；

T 日场内申购的 ETF 份额，T 日可以卖出，T+1 日可以场内、场外赎回；

T 日场内赎回得到的深市组合证券，T 日可以卖出，T+1 日可用于场内、场外申购；

T 日场内赎回得到的深市成份券现金替代和沪市成份券现金替代的资金，T 日可用；

T 日场外申购的 ETF 份额，在交收前不得卖出、赎回；

T 日场外赎回得到的深市组合证券，在交收前不得卖出、申购。

三. 交易数据接口修订

深市 ETF 交易结算模式调整，涉及跨市场股票 ETF 的交易接口变更，以及黄金 ETF、跨市场股票 ETF 的股份使用规则调整。

3.1 跨市场股票 ETF

(1) 跨市场股票 ETF 的场内申赎 pcf 文件，继续使用现有的场内申赎 pcf 文件格式（pcf_NNNNNNNN_YYYYMMDD.xml），其成份证券信息将修改为：

多条非 159900 的深市成份证券、1 条虚拟成份券 159900、以及多条沪市成份证券的记录。其中，159900 记录的申购/赎回替代金额字段，仅表示所有沪市成份证券现金替代的总金额，其中申购替代金额和赎回替代金额取值可能不同。沪市成份证券记录信息，仅做申购赎回参考使用，市场参与人技术系统不能使用沪市成份证券信息进行委托、成交时的现金替代处理，而应该使用 159900 虚拟成份券进行沪市成份证券份额的现金替代处理。

例如，某跨市场股票 ETF 跟踪指数有 10 只深市样本股和 10 只沪市样本股，则场内申赎 pcf 文件应有 21 只成份证券记录：10 只深市样本股成份证券信息、1 只 159900 虚拟券、10 只沪市样本股成份证券信息。159900 的申购替代金额应等于 10 只沪市成份券现金替代总金额(=Σ 现金替代标志为 1 的沪市成份证券的前一交易日收盘价*成份证券数*(1+溢价比例)+Σ 现金替代标志为 2 的沪市成份证券的申购替代金额)，159900 的赎回替代金额应等于 10 只沪市成份券现金替代总金额(=Σ 现金替代标志为 1 的沪市成份证券的前一交易日收盘价*成份证券数*(1-折价比例)+Σ 现金替代标志为 2 的沪市成份证券的赎回替代金额)。深交所仅使用 10 只深市样本股成份证券和 159900 虚拟券信息。

跨市场股票 ETF 的 pcf 文件具体格式，请参见《深圳证券交易所数据文件交换接口规范》的“ETF 实时申购赎回业务参考信息（pcf）”章节、《深圳证券交易所新一代交易系统基金公司数据接口规范》的“PCF 文件”章节。

(2) 跨市场股票 ETF 的场内申赎成功执行报告的成份股记录重复组，将包含多条非 159900 的深市成份证券、以及 1 条虚拟成份券 159900。其中，159900 虚拟券的“现金替代金额”表示沪市所有成份券的现金替代总金额。

(3) 跨市场股票 ETF 的场外申赎（通过中国结算总部申报）的 pcf 文件、委托回报处理等没有变化。场外申赎 pcf 文件的格式和内容，与场内申赎 pcf 文件不同。

四. 结算数据接口修订

4.1 接口修订概述

(1) 深市 ETF 交易结算模式调整，所涉及的需要调整的业务类别及其涵盖的 ETF 品种如下表，业务类别及证券子类别含义可查看《深市登记结算数据接

口规范（结算参与人版）》中附件一及附件二，或查看 SJSGB.DBF 中 GBLB 为‘YL’及‘ZZ’的数据：

结算模式调整	业务类别	业务类别名称	涉及的 ETF 品种
从现行 T+1DVP 模式调整为 A 股交收模式	JY00	集中竞价平台交易，综合金融服务平台交易（担保交收模式）	所有 ETF 品种
	SGSF	实物申购份额	0-单市场 ETF、6-实物债券 ETF
	SGSZ	实物申购现金替代	0-单市场 ETF、6-实物债券 ETF
	SHSF	实物赎回份额	0-单市场 ETF、6-实物债券 ETF
	SHSZ	实物赎回现金替代	0-单市场 ETF、6-实物债券 ETF
	SGXF	现金申购份额	4-货币 ETF
	SGXZ	现金申购现金替代	4-货币 ETF
	SHXF	现金赎回份额	4-货币 ETF
	SHXZ	现金赎回现金替代	4-货币 ETF
从 T+1 日日终逐笔全额非担保交收调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收	SGXF	现金申购份额	7-现金债券 ETF
	SGXZ	现金申购现金替代	7-现金债券 ETF
从 T 日日终逐笔全额非担保交收调整为	SGXF	现金申购份额	5-黄金 ETF

T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非 担保交收	SGXZ	现金申购现金替代	5-黄金 ETF
赎回份额注销时点 从 T+1 日日终调整 为 T 日日终	SHXF	现金赎回份额	2-跨境 ETF、7-现金债券 ETF、8-商品期货 ETF

(2) 深市跨市场 ETF (子类‘3’) 取消了原有场内全额现金申赎模式, 不再使用 SGXZ、SHXZ、SGXF、SHXF 这四个业务类别。新增的场内实物申赎模式, 其中申购份额、申购现金替代、申购组合券、赎回份额、赎回现金替代、赎回组合券业务采用 SGSF、SGSZ、SGSQ、SHSF、SHSZ、SHSQ 业务类别; 所采用的交收方式同单市场 ETF, 为 A 股交收模式。

新增 SGDZ、SHDZ 业务类别, SGDZ 为通过中国证券登记结算有限责任公司总部(以下简称“中国结算总部”)申购的深市跨市场 ETF 现金替代业务, SHDZ 为通过中国结算总部赎回的深市跨市场 ETF 现金替代业务。

申购赎回现金差额、现金替代退补款、申购税费/组合券过户费、赎回税费/组合券过户费业务采用 EFXC、EFTB、SGFY、SHFY 业务类别。调整以后, 深市跨市场 ETF 申赎涉及的业务类别及名称如下表:

业务类别	业务类别名称
SGSF	实物申购份额
SGSZ	实物申购现金替代
SGSQ	实物申购组合券
SHSF	实物赎回份额
SHSZ	实物赎回现金替代
SHSQ	实物赎回组合券
EFTB	ETF 申购赎回现金替代多退少补
EFXC	ETF 申购赎回现金差额
SGFY	ETF 申购税费、组合券过户费
SHFY	ETF 赎回税费、组合券过户费
SGDZ	通过中国结算总部申购的 ETF 现金替代
SHDZ	通过中国结算总部赎回的 ETF 现金替代

4.2 清算明细库 SJSMXn.DBF

4.2.1 SJSMX0.DBF

(1) SJSMX0.DBF 中, 业务类别 SGXF (ETF 现金申购份额)、SGXZ (ETF 现金申购现金替代) 不再包含跨市场 ETF 的数据;

(2) 现金债券 ETF 的申购从 T+1 日日终逐笔全额非担保交收结算模式调整为 T 日日间 RTGS 加 T 日日终逐笔全额非担保交收结算模式，其清算明细数据由 SJS MX1.DBF 调整为通过 SJS MX0.DBF 发送，即 SJS MX0.DBF 中业务类别 SGXZ 和 SGXF 中新增了上述 ETF 品种的数据；

(3) 现金债券 ETF、跨境 ETF 及商品期货 ETF 的赎回份额注销时点从 T+1 日日终调整为 T 日日终，其清算明细数据由 SJS MX1.DBF 调整为通过 SJS MX0.DBF 发送，即 SJS MX0.DBF 中 SHXF（ETF 现金赎回份额）新增了上述 ETF 品种的数据。调整后的 SJS MX0.DBF 业务类别含义如下表：

SJS MX0.DBF 业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
SGXF	黄金 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF、 现金债券 ETF 现金申购份额
SGXZ	黄金 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF、 现金债券 ETF 现金申购现金替代
SHXF	黄金 ETF、 跨境 ETF 、 商品期货 ETF 、 现金债券 ETF 现金赎回份额

(4) SJS MX0.DBF 中，黄金 ETF 现金申购份额、现金申购现金替代明细数据的交收方式字段由‘N’变为‘R’，调整以后业务类别为 SGXF、SGXZ、SHXF 的数据，其字段含义见下表：

字段名	业务类别		
	SGXF(黄金 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金申购份额)	SGXZ(黄金 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金申购现金替代)	SHXF(黄金 ETF、跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金赎回份额)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘SGXF’	‘SGXZ’	‘SHXF’
MXZQDM	ETF 证券代码	ETF 证券代码	ETF 证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号
MXYBYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码

MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量	0	成交数量
MXQSSL	清算数量 (=成交数量)	0	清算数量 (=成交数量)
MXCJG			
MXQSJG			
MXXYJY			
MXPCBS			
MXZQLB	‘EF’	‘EF’	‘EF’
MXZQZL	证券子类别	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’
MXJSFS	‘R’	‘R’	‘N’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ		现金替代金额	
MXYHS			
MXJYJSF			
MXJGGF			
MXGHF			
MXJSF			
MXSXF			
MXQSYJ			

MXQTFY			
MXZJJE			
MXSFJE	0	收付净额	0
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日
MXQTRQ			
MXSCDM			
MXJYFS	‘03’	‘03’	‘03’
MXZQDM2		组合券证券代码	
MXTGDY2			
MXDDBH2			
MXCWDH			
MXPPHM			
MXFJSM			
MXBYBZ			

(5) 为配合基金管理人代收代付的后续优化，SJSMX0.DBF 中管理人的份额记录的 MXJYDY 字段从填写“投资者方的交易单元”修改为填写“投资者方的托管单元”。同时，SJSMX1.DBF、SJSMX2.DBF 及 SJSJG.DBF 接口也做相应调整。

4.2.2 SJSMX1.DBF

(1) SJSMX1.DBF 中, SHXF 业务类别中不再包含跨市场 ETF、跨境 ETF 及商品期货 ETF 的数据; SGSF、SGSZ、SGSQ、SHSF、SHSZ、SHSQ 业务类别新增了跨市场 ETF 的数据。调整后的 SJSMX1.DBF 业务类别含义参见下表:

SJSMX1.DBF 业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
JY00	集中竞价平台交易, 综合金融服务平台交易 (担保交收模式)
SGSF	申购份额, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SGSZ	申购现金替代, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SGSQ	申购组合券, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SHSF	赎回份额, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SHSZ	赎回现金替代, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SHSQ	赎回组合券, 包括单市场 ETF、实物债券 ETF、 跨市场 ETF
SGXF	申购份额, 包括货币 ETF
SGXZ	申购现金替代, 包括货币 ETF
SHXF	赎回份额, 包括货币 ETF
SHXZ	赎回现金替代, 包括货币 ETF

(2) 所有 ETF 品种的交易及单市场 ETF、实物债券 ETF、货币 ETF、跨市场 ETF 场内的申赎结算模式均采用 A 股交收模式。SJSMX1.DBF 中上述业务所涉及到的业务类别, 交收方式字段为‘Y’的数据均调整为‘A’; SGSQ 及 SHSQ 业务类别的数据, 交收方式字段为‘A’, 保持不变。调整以后, 各业务类别的字段含义详见下表:

字段名	业务类别				
	JY00 (所有 ETF 的交易)	SGSF (ETF 申购份额)	SGSZ (ETF 申购现金替代)	SHSF (ETF 赎回份额)	SHSZ (ETF 赎回现金替代)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘JY00’	‘SGSF’	‘SGSZ’	‘SHSF’	‘SHSZ’
MXZQDM	ETF 代码	ETF 代码	ETF 代码	ETF 代码	ETF 代码

MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量	成交数量		成交数量	
MXQSSL	清算数量	清算数量		清算数量	
MXCJG	交易回报价格				
MXQSJG	最终清算价格				
MXXYJY	信用交易标志				
MXPCBS	平仓标志				
MXZQLB	‘EF’	‘EF’	‘EF’	‘EF’	‘EF’
MXZQZL	证券子类别	证券子类别	证券子类别	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’	‘00’	‘00’
MXJSFS	‘A’	‘A’	‘A’	‘A’	‘A’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金		清算本金		清算本金
MXYHS	印花税				
MXJYJSF	交易经手费				
MXJGGF	监管规费				
MXGHF	过户费				
MXJSF	结算费				
MXSXF					
MXQSYJ					
MXQTFY					
MXZJJE					
MXSFJE	收付净额		收付净额		收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日	T+1 日	T+1 日	T+1 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQTRQ					
MXSCDM					
MXJYFS	‘01’或‘02’	‘03’	‘03’	‘03’	‘03’
MXZQDM2			组合券代码		组合券代码

MXTGDY 2					
MXDDBH 2					
MXCWD H					
MXPPHM					
MXFJSM					
MXBYBZ					

字段名	业务类别			
	SGXF (货币 ETF 申购份 额)	SGXZ (货币 ETF 申购资 金)	SHXF (货币 ETF 赎回份 额)	SHXZ(货币 ETF 赎回资 金)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘SGXF’	‘SGXZ’	‘SHXF’	‘SHXZ’
MXZQDM	ETF 代码	ETF 代码	ETF 代码	ETF 代码
MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号	订单编号
MXYYPB	营业部代码	营业部代码	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLS H	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量		成交数量	
MXQSSL	清算数量		清算数量	
MXCJG				
MXQSJG				
MXXYJY				
MXPCBS				
MXZQLB	‘EF’	‘EF’	‘EF’	‘EF’
MXZQZL	证券子类别	证券子类别	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’	‘00’
MXJSFS	‘A’	‘A’	‘A’	‘A’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ		清算本金		清算本金
MXYHS				
MXJSF				

MXJGGF				
MXGHF				
MXJSF				
MXSXF				
MXQSYJ				
MXQTFY				
MXZJJE				
MXSFJE		收付净额		收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日	T+1 日	T+1 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQTRQ				
MXSCDM				
MXJYFS	‘03’	‘03’	‘03’	‘03’
MXZQDM 2				
MXTGDY 2				
MXDDBH 2				
MXCWDH				
MXPPHM				
MXFJSM				
MXBYBZ				

4.2.3 SJSMX2.DBF

(1) 原 SJSMX2.DBF 中的 SGSZ 和 SHSZ 业务类别为通过中国结算总部申赎的深市跨市场 ETF 的现金替代明细清算数据。调整以后，通过中国结算总部申赎的深市跨市场 ETF 的现金替代业务采用的业务类别变更为 SGDZ 和 SHDZ。SJSMX2.DBF 中不再包含业务类别为 SGSZ 和 SHSZ 的数据，新增了业务类别为 SGDZ 和 SHDZ 的数据；SJSMX2.DBF 中的 SHXZ 业务类别中不再包括跨市场 ETF 赎回的现金替代的数据。调整后的业务类别含义表如下：

SJSMX2.DBF 业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
SGFY	ETF 申购税费、组合券过户费
SHFY	ETF 赎回税费、组合券过户费
SGDZ	通过中国结算总部申购的 ETF 现金替代
SHDZ	通过中国结算总部赎回的 ETF 现金替代

SHXZ	ETF 赎回现金替代-代收付
EFXC	ETF 申购赎回现金差额
EFTB	ETF 申购赎回现金替代多退少补
EFSY	货币 ETF 收益

(2) SJSMX2.DBF 新增的 SGDZ 和 SHDZ 业务类别，字段含义见下表：

字段名	业务类别	
	SGDZ(通过中国结算总部 申购的 ETF 现金替代)	SHDZ(通过中国结算总部 赎回的 ETF 现金替代)
MXJSZH	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘SGDZ’	‘SHDZ’
MXZQDM	ETF 代码	ETF 代码
MXJYDY	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码
MXZXBH		
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号
MXCJSL		
MXQSSL		
MXCJG		
MXQSJG		
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	‘EF’	‘EF’
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ		
MXJSFS	‘Z’	‘Z’
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ	负数，应付申购现金替代	正数，应收赎回现金替代
MXYHS		
MXJYJSF		
MXJGGF		
MXGHF		
MXJSF		
MXSXF		
MXQSYJ		
MXQTFY		

MXZJJE		
MXSFJE	负数，应付申购现金替代	正数，应收赎回现金替代
MXCJRQ	成交日期	成交日期
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ		
MXSCDM		
MXJYFS	‘05’	‘05’
MXZQDM2	组合券代码（若基金公司不提供，可能为空）	组合券代码（若基金公司不提供，可能为空）
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH		
MXPPHM		
MXFJSM		
MXBYBZ		

（3）SJS MX2.DBF 中业务类别为 SGFY 及 SHFY 的数据，订单编号、营业部代码、执行编号字段的值，调整为“对于通过总部申赎的跨市场 ETF 填写空”。

字段名	业务类别	
	SGFY（ETF 申购组合券过户费）	SHFY（ETF 赎回组合券过户费）
MXJSZH	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	‘01’	‘01’
MXYWLB	‘SGFY’	‘SHFY’
MXZQDM	ETF 代码	ETF 代码
MXJYDY	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。	订单编号 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。
MXYYB	营业部代码 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。	营业部代码 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。
MXZXBH	执行编号 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。	执行编号 对于通过总部申赎的跨市场 ETF，填写空。
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号

MXCJSL		
MXQSSL		
MXCJIG		
MXQSJG		
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	‘EF’	‘EF’
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	‘00’	‘00’
MXJSFS	‘A’	‘A’
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ		
MXYHS		
MXJYJSF		
MXJGGF		
MXGHF	组合券过户费	组合券过户费
MXJSF		
MXSXF		
MXQSYJ		
MXQTFY		
MXZJJE		
MXSFJE	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T-1 日	T-1 日
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ		
MXSCDM		
MXJYFS	‘03’或‘05’	‘03’或‘05’
MXZQDM2	组合券代码	组合券代码
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH		
MXPPHM		
MXFJSM		
MXBYBZ		

4.3 明细结果库 SJSJG.DBF

(1) SJSJG.DBF 中，不再包含业务类别为 SGSZ（跨市场 ETF 申购现金替代-代收付）、SHSZ（跨市场 ETF 申购现金替代-代收付）的数据；业务类别 SGXF、

SGXZ、SHXF、SHXZ 不再包含深市跨市场 ETF 品种的数据；

新增 SGDZ、SHDZ 业务类别，分别表示通过中国结算总部申购的跨市场 ETF 申购现金替代-代收代付、通过中国结算总部赎回的跨市场 ETF 赎回现金替代-代收代付的明细结果数据；

(2) SJSJG.DBF 中不再包含 SGSF (ETF 实物申购资金交收违约的待处分证券回报)、SGXF (ETF 现金申购资金交收违约的待处分证券回报) 业务类别的数据。调整以后的 SJSJG.DBF 业务类别表参看下表：

SJSJG.DBF业务类别表

接口业务类别	业务类别含义	业务大类
SGSF	黄金ETF实物申购份额	ETF申赎（非担保类）与货币ETF收益交收结果
SHSF	黄金ETF实物赎回份额	
SGXF	跨境ETF、商品期货ETF、黄金ETF、现金债券ETF的现金申购份额	
SGXZ	跨境ETF、商品期货ETF、黄金ETF、现金债券ETF的现金申购现金替代	
SHXF	跨境ETF、商品期货ETF、黄金ETF、现金债券ETF的现金赎回份额	
SHXZ	跨境ETF、商品期货ETF、黄金ETF、现金债券ETF的现金赎回现金替代-代收代付	
SGDZ	通过中国结算总部申购的跨市场ETF申购现金替代-代收代付	
SHDZ	通过中国结算总部申购的跨市场ETF赎回现金替代-代收代付	
EFXC	ETF申购赎回现金差额	
EFTB	ETF申购赎回现金替代多退少补	
EFSY	货币ETF收益	
FGCX	卖空冲销	担保净额DVP交收违约待处置
JY00	集中交易或综合协议交易（担保交收）交收违约的待处分证券回报	

(3) SJSJG.DBF中新增的SGDZ和SHDZ业务类别，字段含义参看下表：

字段名	业务类别	
	SGDZ（中国结算总部申购的跨市场 ETF 申购现金替代-代收代付）	SHDZ（中国结算总部申购的跨市场 ETF 赎回现金替代-代收代付）

JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘SGDZ’	‘SHDZ’
JGZQDM	ETF 代码	ETF 代码
JGJYDY	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户
JGDDBH	订单编号	订单编号
JGYYB		
JGZXBH		
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号
JGCJSL		
JGQSSL		
JGJSSL		
JGCJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	‘EF’	‘EF’
JGZQZL	证券子类别	证券子类别
JGGFXZ		
JGLTLX		
JGJSFS	‘Z’	‘Z’
JGHBDAH	货币代号	货币代号
JGQSBJ	负数, 应付申购现金替代	正数, 应收赎回现金替代
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	负数, 应付申购现金替代	正数, 应收赎回现金替代
JGJSBZ	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’
JGZYDH	若 JGJSBZ 为‘N’,则是错误代号	若 JGJSBZ 为‘N’,则是错误代号
JGCJRQ	成交日期	成交日期
JGQSRQ	T-1 日	T-1 日

JGJSRQ	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	‘05’	‘05’
JGZQDM2	组合券代码(如基金公司 不提供, 则为空)	组合券代码(如基金公司 不提供, 则为空)
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM		
JGBYBZ		

(4) SJSJG.DBF中, 跨境ETF、现金债券ETF、商品期货ETF现金赎回份额 (SHXF), 现金债券ETF现金申购份额 (SGXF) 及现金申购现金替代 (SGXZ) 的明细结果数据的成交日期及清算日期从T-1日调整为T日; 黄金ETF现金申购份额 (SGXF) 及现金申购现金替代 (SGXZ) 明细结果数据的JGJSFS字段从‘N’调整为: ‘R’或‘N’。调整以后, 跨境ETF、现金债券ETF、商品期货ETF、黄金ETF 现金申购赎回的明细结果数据具体字段含义见下表:

字段名	业务类别		
	SGXF (黄金 ETF、 跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金申购份额)	SGXZ (黄金 ETF、 跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金申购现金替代)	SHXF (黄金 ETF、 跨境 ETF、商品期货 ETF、现金债券 ETF 现金赎回份额)
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘SGXF’	‘SGXZ’	‘SHXF’
JGZQDM	证券代码	证券代码	证券代码
JGJYDY	交易单元	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户	证券账户	证券账户
JGDDBH	订单编号	订单编号	订单编号
JGYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码
JGZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
JGCJSL	成交数量	0	成交数量
JGQSSL	清算数量	0	清算数量
JGJSSL	交收数量 (交收失败时为 0)		交收数量 (交收失败时为 0)

JGCJG			
JGQSJG			
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB	‘EF’	‘EF’	证券类别
JGZQZL	证券子类别	证券子类别	证券子类别
JGGFXZ	‘00’	‘00’	‘00’
JGLTLX	‘0’	‘0’	流通类型
JGJSFS	‘R’或‘N’	‘R’或‘N’	‘N’
JGHBDAH	货币代号	货币代号	
JGQSBH			
JGYHS			
JGJYJSF			
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF			
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE			
JGSFJE		收付净额	
JGJSBZ	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’	‘Y’或‘N’
JGZYDH	若 JGJSBZ 为‘N’,则是错误代号	若 JGJSBZ 为‘N’,则是错误代号	若 JGJSBZ 为‘N’,则是错误代号
JGCJRQ	T 日	T 日	T 日
JGQSRQ	T 日	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ			
JGSCDM			
JGJYFS	‘03’	‘03’	‘03’
JGZQDM2		组合券证券代码	
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM			
JGBYBZ			

4.4 股份对账库 SJSDZ.DBF

当日场内交易和申赎的ETF份额变动会体现在当日的股份对账库中。

4.5 资金清算汇总库 SJSQS.DBF

(1) SJSQS.DBF中，SGSZ和SHSZ业务类别中不再包括跨市场ETF实物申赎(总部)的代收代付业务的数据；新增SGDZ和SHDZ业务类别，分别表示通过中国结算总部申购ETF现金替代、通过中国结算总部赎回ETF现金替代的资金清算数据；

(2) SJSQS.DBF中，SGXZ和SHXZ业务类别中不再包括跨市场ETF全额现金申购和全额现金赎回现金替代；调整后的SJSQS.DBF业务含义见下表：

SJSQS.DBF 业务含义表

业务类别	相应业务含义	说明
JY00	集中竞价交易、综合金融服务平台（担保交收模式）交易清算	QSZQDM 为证券类别 成交日期=清算日期（B 股为清算日期-2，延迟交收除外），交收日期=清算日期+1
SGSZ	ETF 申购现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（单市场 ETF、实物债券 ETF、跨市场 ETF）。成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。
SHSZ	ETF 赎回现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（单市场 ETF、实物债券 ETF、跨市场 ETF）。成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。
SGXZ	ETF 申购现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（跨境 ETF、现金债券 ETF、商品期货 ETF、黄金 ETF、货币 ETF）。对于非担保模式（含 RTGS）（跨境 ETF、现金债券 ETF、商品期货 ETF、黄金 ETF 现金申购），成交日期、清算日期和交收日期均为当日；对于担保模式（货币 ETF），成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。 对于非担保模式（含 RTGS），按“证券”+“托管单元”，分买入和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
SHXZ	ETF 赎回现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（跨境 ETF、现金债券 ETF、商品期货 ETF、黄金 ETF、货币 ETF）。对于代收代付（黄金 ETF、商品期货 ETF、跨境 ETF、现金债券 ETF），成交日期=空，交收日期=清算日期+1；对于担保模式（货币 ETF 现金赎回），成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。 对于代收代付，按“证券”+“托管单元”，分买入

业务类别	相应业务含义	说明
		和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
SGDZ	通过中国结算总部申购 ETF 现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（跨市场 ETF 实物申购），成交日期为空，清算日期为当日，交收日期=清算日期+1；按“证券”+“托管单元”，分买入和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
SHDZ	通过中国结算总部赎回 ETF 现金替代	QSZQDM 为 ETF 证券代码（跨市场 ETF 实物赎回），成交日期为空，清算日期为当日，交收日期=清算日期+1；按“证券”+“托管单元”，分买入和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
SGFY	ETF 申购税费、组合券过户费	QSZQDM 为 ETF 证券代码。 成交日期=清算日期-1，交收日期=清算日期+1。 本记录为上个交易日申购业务相关的费用。
SHFY	ETF 赎回税费、组合券过户费	QSZQDM 为 ETF 证券代码。 成交日期=清算日期-1，交收日期=清算日期+1。 本记录为上个交易日赎回业务相关的费用。
EFXC	ETF 申购赎回现金差额	QSZQDM 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。 买入金额为补款金额，卖出金额为退款金额。 对于某“证券”+“托管单元”，分买入和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
EFTB	ETF 申购赎回现金替代多退少补	QSZQDM 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。 买入金额为补款金额，卖出金额表示退款金额。 对于某“证券”+“托管单元”，分买入和卖出各下发一条记录。买入记录中的卖出金额为 0，卖出记录中的买入金额为 0。
EFSY	货币 ETF 收益	QSZQDM 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。 QSMCJE 为基金收益。

(3) SJSQS.DBF中所涵盖的以担保方式交收的ETF交易、申赎相关的业务，交收方式字段为‘Y’的变更为‘A’。

(4) SJSQS.DBF中ETF品种涉及的业务类别的对应关系调整为下表：

ETF 品种	涉及的业务类别
单市场 ETF	SGSZ、SHSZ、EFXC、EFTB、SGFY、SHFY
实物债券 ETF	SGSZ、SHSZ、EFXC、EFTB、SGFY、SHFY
现金债券 ETF	SGXZ、SHXZ、EFXC、EFTB
跨市场 ETF	SGSZ、SHSZ、EFXC、EFTB、SGFY、SHFY、SGDZ、SHDZ
跨境 ETF	SGXZ、SHXZ、EFXC、EFTB
商品期货 ETF	SGXZ、SHXZ、EFXC、EFTB
黄金 ETF	SGXZ、SHXZ、EFXC、EFTB
货币 ETF	SGXZ、SHXZ、EFXC、EFTB

4.6 T+0 资金清算汇总库 SJSQS0.DBF

ETF 交易和申赎现金替代（担保类），从担保 DVP 模式调整为 A 股交收模式。SJSQS0 中所涵盖的以担保方式交收的 ETF 交易、申赎相关的业务，交收方式字段为‘Y’的调整为‘A’。

SJSQS0 清算业务含义表（表 3-2）

新业务类别	相应业务含义	说明
JY00	交易	担保模式
SGSZ	申购现金替代	担保模式
SHSZ	赎回现金替代	担保模式
SGXZ	申购现金替代	担保模式
SHXZ	赎回现金替代	担保模式

4.7 资金变动库 SJSZJ.DBF

SJSZJ.DBF 中，SGXZ 和 SHXZ 中不再包括跨市场 ETF 品种；新增 SGDZ 和 SHDZ 业务类别，分别表示通过中国结算总部申购 ETF 现金替代业务资金变动和通过中国结算总部赎回 ETF 现金替代业务资金变动。调整后的 SJSZJ.DBF 业务类别含义如下表：

SJSZJ.DBF 中业务类别含义表

ZJYWLB	业务类别含义	ZJZQDM
SGFY	ETF 申购税费、组合券过户费	证券代码
SGSZ	ETF 申购现金替代	证券代码
SGXZ	ETF 申购现金替代	证券代码
SHFY	ETF 赎回税费、组合券过户费	证券代码

SHSZ	ETF 赎回现金替代	证券代码
SHXZ	ETF 赎回现金替代	证券代码
SGDZ	通过中国结算总部申购 ETF 现金替代	证券代码
SHDZ	通过中国结算总部赎回 ETF 现金替代	证券代码

4.8 资金余额库 SJSYE.DBF

SJSYE.DBF 中，原 T+1 担保 DVP 结算模式的 ETF 业务更改为 A 股交收模式，在计算可提金额 SJSYE.YEKTZJ 时，ETF 交收净额与原 A 股交收净额合并处理。

4.9 广播类信息库 SJSGB.DBF

SJSGB.DBF 中权益参数的发送日期发生调整，从“权益参数在权益登记日（对 ETF 和 B 股为最后交易日）发送”调整为“权益参数在权益登记日（B 股为最后交易日）发送”。

4.10 综合数据服务库 SJSFW.DBF

通过托管人结算的、采用担保结算模式的 ETF 申赎类业务纳入托管人结算保证金额度的计算范围，其中 ETF 结算备付金账户的日均结算净额将合并计入其托管人综合结算备付金的日均结算净额中，并进行保证金调整的计算。SJSFW.DBF 中，FWSJLB 为‘0A’（A 股保证金调整计算明细数据）的数据，对于托管人托管的 ETF 产品申购赎回的日均结算净额，FWZQZH 字段为对应的 ETF 产品的结算账号。调整以后，SJSFW.DBF 中业务类别为‘0A’的数据，各字段含义如下：

字段名	数据类别说明含义
FWSJLB	0A
FWJSZH	结算账号
FWBFZH	备付金账户
FWTGDY	
FWZQDM	
FWZQZH	对托管人托管产品的数据,为对应产品的股东代码；对 ETF 结算账户的申购赎回数据，为 ETF 结

	算账号；其他情况本字段为空
FWGFXZ	
FWLTLX	
FWMRJE	本期保证金调整时间段内的权益类日均结算净额
FWMCJE	本期保证金调整时间段内的固定收益类日均结算净额
FWZJYE	
FWSL1	
FWSL2	
FWCLRQ	T日
FWFSRQ	T日
FWZYSM	第1到第8个字符为本期保证金调整时间段的开始日期，第9到第16字符为本期保证金调整时间段的结束日期。日期格式为YYYYMMDD
FWBZSM	
FWBYBZ	

五. 联系方式

深圳证券交易所：

业务咨询：0755-88668839, 0755-88668817

技术咨询：0755-88668196, 0755-88668727

中国结算深圳分公司：

业务咨询：0755-21899269

技术咨询：0755-25946080

深圳证券交易所

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

2019年4月8日