

工程技术标准

深圳市场首次公开发行股票采用市值 配售业务之券商技术系统变更指南 (Ver1.01)



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
二〇一五年十一月

关于本文档

文档名称		深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务之券商技术系统变更指南	
说明			
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2015-11-09	1.00	创建文档	技术开发版
2015-11-23	1.01	修订	修订SJSFX 业务类别‘A3’的说明；新增SJSGB的接口说明。

目录

一、	说明.....	1
二、	业务说明.....	1
1.	交易流程.....	1
2.	投资者适当性管理.....	2
三、	清算交收.....	2
四、	开展深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务时券商系统注意事项.....	3
五、	联系方式.....	3
附件一、	深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务的结算数据接口修订说明.....	5
1.	接口简要说明.....	5
2.	非交易报送库 FJYBS.DBF 与非交易确认库 FJYQR.DBF.....	5
3.	发行可申购额度库 SJSKS.DBF.....	5
4.	发行信息库 SJSFX.DBF.....	6
5.	资金清算库 SJSQS.DBF.....	7
6.	资金结算信息库 SJSZJ.DBF.....	7
7.	资金余额库 SJSYE.DBF.....	8
8.	广播类信息库 SJSGB.DBF.....	8
9.	其它信息.....	9

深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务 之券商技术系统变更指南

一、说明

为了使证券公司更好地开展深圳市场首次公开发行股票（以下简称“IPO”）采用市值配售业务，深圳证券交易所（以下简称“深交所”）会同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”）专门编制和发布本指南，供相关证券公司及其 IT 提供商参考。

本次改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量减少系统改造对证券公司带来的影响。

特别提示：如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应修订。

二、业务说明

深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务是指：投资者在新股发行申购日（T 日，下同）无需缴纳申购款，T+2 日投资者应根据中签结果履行资金交收义务。若中签投资者认购资金不足，T+3 日 15:00 前参与人向中国结算深圳分公司申报投资者放弃认购数据，15:00 后中国结算深圳分公司对于放弃认购的数据进行处理，记减投资者相应的中签数据。T+3 日 16:00 中国结算深圳分公司对中签认购资金进行非担保交收，对于资金不足部分确认为无效认购，根据相关业务规则，进行拉单处理。因资金不足而放弃认购的新股，由主承销商包销。

1. 交易流程

网上发行流程简述，详细流程请参见《深圳市场首次公开发行股票网上发行实施细则》。

	日期	步骤
1.	T-1	中国结算深圳分公司下发投资者可申购额度。
2.	T	投资者申购委托，无需缴纳申购款。

3.	T日15:00后	中国结算深圳分公司确认有效申购量并配号。
4.	T+1日	主承销商在指定媒体公布中签率;主承销商组织摇号抽签,中国结算深圳分公司收市后向结算参与人发送中签数据。
5.	T+2日	中国结算深圳分公司向结算参与人发送中签后资金清算结果。
6.	T+2日16:00前	投资者应根据中签结果履行资金交收义务,若中签投资者认购资金不足,T+3日15:00前参与人向中国结算深圳分公司申报投资者放弃认购。
7.	T+3日15:00前	结算参与人于T+3日15:00前通过D-COM系统向中国结算深圳分公司申报放弃认购。
8.	T+3日15:00后	中国结算深圳分公司对于放弃认购的数据进行处理,记减投资者相应的中签数据。
9.	T+3日16:00	中国结算深圳分公司对中签认购资金进行非担保交收,对于资金不足部分确认为无效认购,根据相关业务规则,进行拉单处理。因资金不足而放弃认购的新股,由主承销商包销。
10.	T+4日	主承销商依据承销协议将认购资金扣除承销费用后划转到发行人指定的银行账户。

2. 投资者适当性管理

针对创业板股票发行,证券公司应当按照中国证监会及深交所相关规定,实施投资者适当性管理。

三、清算交收

对于IPO市值配售业务,新股认购资金采用非担保交收方式。中国结算深圳分公司将于T+2日和T+3日通过D-COM系统向相关结算参与人分别发送SJSQS.DBF和SJSZJ.DBF两个接口文件,分别表示T+2日认购资金的清算结果和T+3日认购资金的变动结果,业务类别包含'FXSG','FXJD','FXFK'(其中'FXFK'为付承销商款的资金变动)。

对于股份数据，中国结算深圳分公司将通过 D-COM 系统向相关结算参与人发送 SJSKS.DBF 及 SJSFX.DBF 二个接口文件，分别表示新股市值配售业务的投资者市值数据及新股股份交收结果明细。

关于以上数据接口更多具体内容请详见附件一、深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务的结算数据接口修订说明。

四、开展深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务时券商系统注意事项

1、结算参与人通过 D-COM 业务终端的放弃认购申报功能对投资者放弃认购部分进行申报，或通过数据接口非交易报送库 FJYBS.DBF 进行申报。

2、每交易日深圳市场的新股申购委托笔数容量目前设置为 5000 万笔，各相关单位应参考该容量，高度重视并积极开展性能和容量优化等相关工作：

- 根据所占市场份额，合理确定自身技术系统性能和容量目标；
- 对各技术系统的硬件、软件、网络带宽、网关报盘速率、存储等资源进行评估，对包括但不限于查询、申报等在内的交易清算各环节进行排查，及时消除各类安全运行隐患；
- 为应对大量新股申购委托可能集中在特定时段（如收市前）申报，挤占网络带宽或网关报盘速率，建议券商技术系统采用扩容、错开委托高峰、降低新股申购委托优先级等策略，避免对二级市场交易造成影响。

深交所将根据市场情况动态调整系统性能和容量，各相关单位应建立科学的性能和容量管理制度，及时调整、持续优化。

3、网上发行新股申购指令的申报方式、回报方式及接口约定未做任何变化，即券商技术系统仍在正常交易日的正常交易时间内通过竞价交易网关的委托库 SJSWT.DBF 向深交所交易系统申报，申报当日有效，一经申报不得撤销；同时券商技术系统仍通过竞价交易网关的回报库 SJS HB.DBF 接收回报数据，此回报结果仅表明深交所交易系统对新股申购指令的初步处理结果，最终是否有效申购仍以中国结算深圳分公司的处理结果为准。

五、联系方式

业务：0755-88668340（交易）

0755-25947680（结算）

技术：0755-88668480、88668467（交易）Email: ssegcb@szse.cn
0755-25946080（结算）Email: szjsb@chinaclear.com.cn

附件一、深圳市场首次公开发行股票采用市值配售业务的结算数据接口修订说明

1. 接口简要说明

中国结算深圳分公司每日日终将通过D-COM 系统向相关结算参与人发送 SJSKS.DBF、SJSFX.DBF、**SJSGB.DBF**、SJSQS.DBF及SJSZJ.DBF接口文件，分别包含IPO市值配售的投资者市值、新股股份数据交收结果、**发行参数**、资金汇总清算数据及资金变动数据。

2. 非交易报送库 FJYBS.DBF 与非交易确认库 FJYQR.DBF

结算参与人T+3日可以通过D-COM业务终端的放弃认购申报功能对投资者放弃认购部分进行申报，也可以通过数据接口非交易报送库FJYBS.DBF进行申报。放弃认购业务支持多次申报和撤单，具体指令的元素见下表，指令申报的截止时间为当日15:00。中国结算深圳分公司将对申报指令有效性进行实时检查，并通过数据接口非交易确认库FJYQR.DBF实时回报检查结果。

非交易报送库FJYBS.DBF与非交易确认库FJYQR.DBF的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版Ver5.00）》。

BSYWLB	BSWTLX	业务字段的填报说明
8C	S/申报	BSZQDM, BSGDDM, BSXWDM, BSWTSL
		参与人可通过本指令申报市值配售新股发行业务中签后的放弃认购委托。BSZQDM 填写中签的证券代码；BSXWDM 填写中签的托管单元编码；BSGDDM 填写中签股东代码；BSWTSL 为放弃认购的股数，填正数。
	C/撤单	BSWTXH
		BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。

3. 发行可申购额度库 SJSKS.DBF

中国结算深圳分公司每日通过SJSKS.DBF发送前一工作日深圳市场证券账户

市值数据。发行可申购额度库SJSKS.DBF的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版Ver5.00）》。

日期	说明
T-2 日	<p>根据深市投资者持有的市值以投资者为单位进行计算。</p> <p>投资者的同一证券账户在不同证券营业部托管的，其市值合并计算。投资者持有多个证券账户的，根据“账户持有人名称”、“有效身份证明文件号码”均相同进行市值合并计算。</p> <p>持有市值 1 万元以上（含 1 万元）的投资者计算可申购额度，每 5000 元市值折算为 500 股可申购额度，不足 5000 元的部分不计入申购额度，可申购额度为 500 股的整数倍。</p>
T-1 日	<p>发送可申购额度数据。若同一有效深市账户在不同托管单元托管有股份，则每个托管单元均会收到该深市账户的可申购额度，且相同。</p>

4. 发行信息库 SJSFX.DBF

中国结算深圳分公司T日通过SJSFX.DBF向相关结算参与人发送配号及申购不确认数据，T+1日通过SJSFX.DBF向相关结算参与人发送中签数据，T+3日通过SJSFX.DBF向相关结算参与人发送最终认购数据；

对于T日因投资者进入‘不良记录’名单而导致的申购拉单，反馈数据为：业务类别‘A1’，错误原因为FXCWDH=‘E26’（‘限制申购导致无效’）；

发行信息库SJSFX.DBF的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版Ver5.00）》。

日期	业务类别	说明
	FXYWLB	

日期	业务类别 FXYWLB	说明
T 日 (申购日)	A1, 申购不 确认记录	因证券账户无效等原因引起的不确认记录, FXQRGS=不确 认股数, FXZJJE=0, FXCWDH=不确认原因代号
	A2, 配号记 录	FXWTGS=起始配号, FXQRGS=连续配号个数, FXZJJE=0。 投资者若超额申购, 则只返回确认的配号数量。
T+1 日 (中签日)	A3, 中签记 录	一个中签号码一条记录, 若同一投资者有多个中签号码, 则有多条记录。 其中, FXWTGS=中签号码, FXQRGS=中签股数, FXZJJE=认 购价格。
T+3 日 (放弃日)	A5, 市值配 售确认记录	FXWTGS=中签股数, FXQRGS=最终确认股数(若申报了放弃 认购股数, 则 FXQRGS= FXWTGS- 放弃认购股数-资金缺口 引起拉单数量, 否则 FXQRGS= FXWTGS); FXZJJE=认购价 格; FXQRGS*FXZJJE=最终应扣资金; FXWTXH=空格;

5. 资金清算库 SJSQS.DBF

中国结算深圳分公司T+2日通过SJSQS.DBF向相关结算参与者发送T+3日应交
收的认购资金汇总清算数据。资金清算库SJSQS.DBF的具体结构及定义请参见《深
市登记结算数据接口规范(结算参与者版Ver5.00)》。

日期	业务类别	说明
T+2 日	FXSG	市值配售认购中签需缴款数据; QSZQDM 为证券代码; QSMRJE 为新股认购款

6. 资金结算信息库 SJSZJ.DBF

中国结算深圳分公司 T+3 日通过 SJSZJ.DBF 向相关结算参与者发送 T+3 日认
购资金变动数据。资金结算信息库 SJSZJ.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登

记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》。

日期	业务类别	说明
T+3 日	FXSG	市值配售新股认购资金；
	FXJD	市值配售不足资金； FXSG 的资金与 FXJD 的资金之差，为真正有效的认购资金
T+3 日	FXFK	付承销商款数据，主承销商会收到； ZJZQDM 为证券代码；ZJMCJE 为付承销商款

7. 资金余额库 SJSYE.DBF

T+2 日的 SJSYE.DBF 中，可提资金额、待收付金额、新股申购资金中都将包括市值配售新股认购款的数据。资金余额库 SJSYE.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》。

8. 广播类信息库 SJSGB.DBF

SJSGB.DBF 为结算公司发送的广播类数据，每日通过 D-COM 发送给所有参与人。本次新增证券的发行参数信息，广播类别为‘FX’，包括 IPO、LOF 及 ETF 发行、增发、可转债的发行参数（债券分销及配股认购除外）。在发行申购日前一工作日开始到发行结束前一工作日，每天发送。

广播类信息库 SJSGB.DBF 的具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》。

字段名	字段描述	类型	长度	说明
GBLB	广播类别	C	2	‘FX’
GBDM1	代码 1	C	6	发行证券代码
GBDM2	代码 2	C	10	发行方式（左对齐右补空格） 取值为：

				‘1’ - 市值配售方式 ‘2’ - 上网定价方式 ‘4’ - 增发定价方式 ‘5’ - 增发竞价方式 ‘6’ - LOF/ETF 连续认购方式
GBSL	数量	N	12, 0	
GBRQ1	日期 1	D		中签日期。无中签操作的发行方式，此处为‘0001-01-01’
GBRQ2	日期 2	D		
GBBL	比例	N	19, 13	
GBJE1	金额 1	N	18, 3	发行方式为 ‘1’，‘2’，‘4’，‘6’ 时，字段表示发行价格； 发行方式为 ‘5’ 时，字段表示竞价低价。
GBJE2	金额 2	N	18, 3	发行方式为 ‘1’，‘2’，‘4’，‘6’ 时，字段赋值为发行价格； 发行方式为 ‘5’ 时，字段表示竞价高价。
GBZD	保留字段	A	50	
GBRQ	广播日期	D		当前工作日

9. 其它信息

(1) 《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.00）》可在中国结算网站 www.chinaclear.cn 首页之“服务支持”-“业务资料”-“接口规范”-“深圳市场”或深交所网站 www.szse.cn 首页之“技术专栏”下载。

(2) 《深圳证券交易所数据接口规范（Ver4.72）》可在深交所网站 www.szse.cn 首页之“技术专栏”下载。

(3) 联系方式

Email:szjsb@chinaclear.com.cn

电话: 0755-25946080