基金行业集中备份数据报送

技术帮助文档

## 报送频率

公募基金（含投资者超200人的券商集合计划）、非公募基金（含基金公司专户、投资者200人以下券商集合计划等。注意一对一产品也包含）的TA于2017年9月1日起，按中国结算通知分批报送全量数据（具体通知见中国结算官网：开放式基金平台/基金中央数据交换平台），全量报送日之后每日报送增量（T1/T2/TM/TN文件每日需报全量），每半年报送全量数据。

对同时登记公募和非公募基金的TA，文件应按技术接口规范中的公募和私募规则命名。首次及后续报送全量数据、持续报送增量数据时，均应同时报送TA登记的全部公、私募基金数据。其中，报送增量数据时，T1/T2/TM/TN文件均需报送全量数据。因基金账户为公私募共用，报送增量/全量数据时账户信息仅通过92/Q2文件报送，Z2/S2须报送空文件。

每个数据申报日，参与人即使当日无数据，也应报送空的索引文件（文件中“文件个数”为0），表示当日已报送。

注：管理人自建TA需报送数据，但分TA无需报送（由中国结算TA代为报送）。若存在一个产品部分由自建TA登记、部分由中国结算TA登记的情况，自建TA应报送其登记的那部分数据。

## 数据拆分与压缩

若单个数据文件（压缩前）超过3GB，须拆为多个文件发送(即每个数据文件不超过3GB) ，在文件名后增加批次号，比如OFD\_***gg\_00\_yyyymmdd***\_Q5\_001.TXT、 OFD\_***gg\_00\_yyyymmdd***\_Q5\_002.TXT等。拆分后的文件仍遵照接口规范，文件头中记录数为本批次数据记录数。在索引文件中(注意：索引文件不可拆分)应囊括所有数据文件名，即包含“OFD\_***gg\_00\_yyyymmdd***\_Q5\_001.TXT、 OFD\_***gg\_00\_yyyymmdd***\_Q5\_002.TXT”等文件名。

拆分后的数据文件需要重传时：若需更正某个批次的数据，则重传相同批次号的数据文件，将覆盖原批次号的内容；若需作废某个批次数据，则重传该批次的空数据文件（文件头中记录数为0）。若需追加一些数据批次，则除发送追加批次的数据外，还需重新发送索引文件（文件名列表需包含原有批次和追加批次）。

单个文件若大于100M，要求采用ZIP（或BZ2）格式进行压缩,不支持其他压缩格式，不允许分卷压缩。压缩文件名称应保持与原文件名称一致，后缀由原TXT改为ZIP（或BZ2）。注意索引文件中列出的文件名仍使用原‘TXT’文件名。

## 数据通信机制

报送机构通过深证通FDEP软件发送文件至中国结算，中国结算小站号（生产系统）：R\_BEIJING02。

每个数据申报日，参与人必须发送当日索引文件。索引文件列出的“文件个数”为0表示当日无数据，否则所列数据文件必须发送。索引文件中不允许出现接口规范中未定义的数据文件名。

若参与人发送与自身业务范围外的接口文件, 中国结算会返回“文件名.DEN”,若接口文件未通过中国结算检查，中国结算会返回“文件名.ERR”文件，, 并在文件内容中说明具体原因, 成功则返回“文件名.ACC”文件。参与人应于2工作日内重新报送（参与人自身发现了2工作日内的数据报错，也应重新报送）。比如参与人2017.3.3日发现3.1日数据有错、3.2日数据正确，应重新发送3.1日数据（数据文件名仍保持原文件名，不要合并到3.3日文件内容中）；若两日数据均有错，则均需重新报送。

中国结算在成功接收数据后，将于24小时内返回对应的账户、份额对账统计信息文件供参与人核对，文件名分别为[YYYYMMDD]\_00\_[TA]\_ACCOUNT.XML和[YYYYMMDD]\_00\_[TA]\_VOLUME.XML，内容详见附件一。

## 参与人编码

TA代码：优先使用行业编码中心分配的两位TA代码。若为私募基金管理人自建TA系统，仅登记私募产品且无两位TA代码，则填写私募基金管理人8位编码（基金业协会分配）。

销售机构代码：不允许使用自定义编码。销售机构同时销售公私募产品的，应使用行业编码中心分配的3位编码；若为私募管理人直销，且没有行业编码中心分配的3位编码，则填写私募管理人的8位编码。

填写“组织机构代码”信息时，注意要去掉中划线‘-’。

## 账户信息通知（92/Z2/Q2/S2文件）

在报送全量账户信息通知（Q2/S2）时：“业务代码”填写“114”；针对同一基金账户，若在一个销售机构处存在多个交易账户的，应报送多条记录；“交易确认日期”填写“账户注册日期”。

由于92文件中的 “个人/机构标志”中扩展了“产品”类别，“证件类型”、

“投资者类型”、“投资者产品代码”字段的准确报送依赖于《基金行业数据交换协议》（原《开放式基金业务数据交换协议》）的同步扩展和实施，待《基金行业数据交换协议》正式发布后，上述字段应准确填报。

 增加交易账户（108）业务报送时，字段赋值要求参照“变更交易账户（158）业务”，但有两点差别，一是“TransactionAccountID（投资人基金交易账号）”填写新增的交易账户，二是“TargetTransactionAccountID（对方销售人处投资人交易账号）”字段应赋值为空。

## 交易确认（94/Z4文件）

针对出现在“业务数据项”章节中的部分字段，若未出现在94/Z4文件中，但报送94/Z4文件时仍需报送这些字段。

 基金转换（136）业务报送时，若为同一TA不同基金之间的转换，业务代码填写136，报送一笔即可；若为不同TA的基金之间的转换，业务代码应根据TA为转出方或转入方分别填写138（基金转换出）或137（基金转换入），转出方TA和转入方TA各自报送一笔。

 非交易过户业务（133）业务报送时,业务代码填写133，报送一笔即可。若跨销售机构，需填写“TargetDistributorCode（对方销售人代码）”字段。

快速过户确认（198）业务报送时，业务代码填写198，报送一笔即可，字段赋值要求参照非交易过户业务（133）。

## 份额对账（95/Z5文件）

增量报送时注意：若投资者上日份额不为零但当日清零（包括因变更交易

账号导致的原交易账号份额清零），也需报送。

 关于明细标志为0、1、2时的报送方式说明：

1）按基金汇总的记录（明细标志：0）：无论增量或全量，每只基金都应有一条记录。

2）按投资者汇总（同一基金账户、交易账户、销售机构、网点、基金代码、份额类别）的记录（明细标志：1）：增量报送时，若投资者份额发生变动，该记录必须报送。全量报送时，应报送所有投资者的记录。

3）按投资者明细的记录（明细标志：2）：可选报送或不报送。在增量报送时，注意若某个投资者某个“份额注册日期”或“TA确认流水号”上的份额发生了变化，应将该投资者所有“份额注册日期”或“TA确认流水号”上的对账数据全部发送（而非仅发送某个“份额注册日期”或“TA确认流水号”上的数据）。

若因特殊情况，只需报送部分产品的全量数据，需联系中国结算。

## 基金TA参数（T1/TM文件）

对投资者超200人的券商集合计划，其“公募标识”为“1：公募”（报送数据均归到公募文件中）；投资者人数200以下的，其“公募标识”为“0：非公募”。注意券商集合计划的“基金类型”字段均应为“非公募产品”类别中的“证券公司集合理财产品”、“证券公司专项资管计划”、“证券公司定项资管计划”。

对分级的货币或债券等基金，若非“优先劣后分级”也非“优先顺序分级”，则“分级标识”填写“非分级”。

基金产品终止后的下一报送日应当报送一次，之后不用再报送。

## 基金运作信息（T2/TN文件）

T2/TN文件：每日报送全量时，指TA系统中所有基金的最新净值和净值日期，比如对普通公募基金一般为上日净值（净值日期为T-1日），对QDII基金一般为T-2净值（净值日期为T-2日）。对于当日估出多日申购赎回净值的情况，应当报送所有当日估出的净值和净值日期，如果当日未估值，则应当取最近一个估值日估出的净值和净值日期。

## 其它

首次报送前已终止的公募基金产品不用报送全量数据。

## 测试安排

请关注我司2017年8月在中国结算官网上挂出测试通知。

## 本文档的更新

本文档将不定期进行更新（文件名中会包含最后更改日期），发布到中国结算网站。

附件一：账户、交易统计信息文件格式

# 一、账户统计信息文件

* 文件名称:[YYYYMMDD]\_00\_[TA]\_ACCOUNT.XML
* [TA]：TA代码
* [YYYYMMDD]：日期，例如20170712（与报送文件的日期相同）

## 文件格式

|  |
| --- |
| <?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?><account RegisterCode="" Date=""> <acctStat F92=""> <list> <acctNum IndividualOrInstitution="0" F92=""/> <acctNum IndividualOrInstitution="1" F92=""/> <acctNum IndividualOrInstitution="2" F92=""/> </list> </acctStat> <tranStat> <list> <tranNum BusinessCode="" F92=""/> <tranNum BusinessCode="" F92=""/> </list> </tranStat> <checkStat> <totalDiff FQ2="" Diff=""/> <groupDiff> <list> <acctNum IndividualOrInstitution="0" FQ2="" Diff=""/> <acctNum IndividualOrInstitution="1" FQ2="" Diff=""/> <acctNum IndividualOrInstitution="2" FQ2="" Diff=""/> </list> </groupDiff> </checkStat></account> |

## xml元素说明

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 元素名 | 属性 | 解释 |
| account | RegisterCode | TA代码 |
| Date | 日期，格式为yyyymmdd |
| acctStat | F92 | 根据上一次全量及之后的92增量文件，统计的基金账户数（一个基金账户对应多个销售机构及多个交易账户，只按一个算） |
| list |  | 指明其父标签的内容为list |
| acctNum | IndividualOrInstitution | 个人/机构标志，0-机构，1-个人，2-产品 |
| F92 | 根据上一次全量及之后的92增量文件，统计的基金账户数 |
| FQ2 | 从Q2全量文件中统计的基金账户数 |
| Diff | （从Q2中统计的数FQ2）-（从92中统计的数F92）增量累积数与全量的差值，用于增量全量同时发送时做比较。 |
| tranStat |  | 交易数统计 |
| tranNum | BusinessCode | 业务代码，取值：101、102、103、108、158 |
| F92 | 从92增量文件中统计的数据记录数 |
| checkStat |  | 稽核统计，该元素下的Diff值，区分正负Diff值为从全量中统计值-从增量中统计值 |
| totalDiff | FQ2 | 从Q2全量文件中统计的账户数 |
| Diff | 从Q2全量文件中统计的账户数（FQ2）-从92文件中统计的账户数（F92） |
| groupDiff |  | 分组统计账户数 |

## 说明

* 基金账户统计范围：仅统计基金账户状态为正常的。
* F92：根据上一次全量数据、以及上一次全量报送日到当前日期的所有92增量数据，统计出的数值。

# 二、份额对账统计信息文件

* 文件名称:[YYYYMMDD]\_00\_[TA]\_VOLUME.XML
* [TA]：TA代码
* [YYYYMMDD]：日期，例如20170712（与报送文件的日期相同）

## 文件格式

|  |
| --- |
| <?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?><volume RegisterCode="" Date=""> <shareholder> <list> <acctNum FundCode="" F95=""/> </list> </shareholder> < fundSize > <list> <size FundCode="" F95\_0="" F95\_1=""/> </list> </fundSize> <checkStat> <shareholderDiff> <list> <acctNum FundCode="" FQ5="" Diff=""/> </list> </shareholderDiff> <volumeDiff> <list> <size FundCode="" FQ5\_0="" FQ5\_1="" Diff\_0="" Diff\_1=""/> </list> </volumeDiff> </checkStat></volume> |

## xml元素说明

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 元素名 | 属性 | 解释 |
| volume | RegisterCode | TA代码 |
| Date | 日期，格式为yyyymmdd |
| shareholder |  | 基金持有人 |
| list |  | 指明其父标签的内容为list |
| acctNum | FundCode | 基金代码 |
| F95 | 根据上一次全量及之后的95增量文件，统计出的持有该基金份额不为0的基金账户数（一个基金账户对应多个销售机构及多个交易账户，只按一个算） |
| FQ5 | 从Q5全量文件中统计的持有该基金的基金账户数 |
| Diff | FQ5- F95（增量累积数与全量的差值） |
| FundSize |  | 基金规模统计 |
| size | FundCode | 基金代码 |
| F95\_0 | 从95文件中，按照明细标志为0，统计该基金规模 |
| F95\_1 | 从95文件中，按照明细标志为1，统计该基金规模 |
| FQ5\_0 | 从Q5文件中，按照明细标志为0，统计该基金规模 |
| FQ5\_1 | 从Q5文件中，按照明细标志为1，统计该基金规模 |
| Diff\_0 | FQ5\_0- F95\_0 |
| Diff\_1 | FQ5\_1- F95\_1 |
| checkStat |  | Q5文件与95文件核对结果 |
| shareholderDiff |  | 基金持有人账户差异统计 |
| volumeDiff |  | 基金份额差异统计 |

## 说明

* F95：根据上一次全量数据、以及上一次全量报送日到当前日期的所有95增量数据，统计出的数值。

 中国证券登记结算公司基金业务部

 　　　　 　 2017.8.21