

编号: _____
密级: _____



中国结算工程技术文档

中国结算深圳分公司证券交易资金前端风险控制 业务结算参与人技术系统变更指南



中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇一八年二月二日

关于本文档

文档名称		中国结算深圳分公司证券交易资金前端风险控制业务结算参与人技术系统变更指南	
说明		券商、托管银行等相关单位进行相关技术准备工作的指南	
修订历史			
日期	版本	操作	说明

前 言

为确保证券交易资金前端风险控制业务的顺利开展，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“我司”）将进行相关技术改造，并调整相关结算数据接口。为帮助结算参与人及其 IT 供应商改造相关技术系统，本公司特此编制和发布本指南。

本指南中未涉及的详细内容请参见我司此前公布的数据接口规范及相关通知。如业务规则及指南有所变更，本指南将做相应变更。

请各结算参与人于 2018 年 4 月前做好相关技术准备，届时我司将根据市场准备情况组织仿真测试和全网测试。

目 录

一、 背景简介.....	1
二、 业务说明.....	1
(一) 业务简介	1
(二) 常规申报	3
1. 申报时间	3
2. 最高额度申报标准	3
3. 数据校验标准	3
4. 常规额度的生成与发送	4
5. 常规额度的撤销与更新	4
(三) 盘中紧急申报	4
1. 申报时间	4
2. 数据校验标准	4
3. 最高额度的发送	5
4. 最高额度的撤销与更新	5
(四) 最高额度信息反馈、查询	5
(五) 其他注意事项	5
三、 D-COM 业务终端调整.....	6
四、 接口调整.....	6
(一) SJSFW 接口调整	6
(二) SJSJG 接口调整	7
(三) XML 实时报文接口调整	10
五、 联系方式.....	10

中国结算深圳分公司证券交易资金前端风险控制 结算参与人技术系统变更指南

一、背景简介

为防范交易参与人、结算参与人因技术故障、操作失误等造成的交易异常风险和结算风险，维护交易结算秩序，保障证券市场安全稳定运行，上海证券交易所、深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）于2017年12月1日发布了《上海证券交易所 深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务实施细则》¹。

为确保深市证券交易资金前端风险控制业务（以下简称“资金前端控制业务”）的顺利开展，我司将对登记结算技术系统进行相应的改造，并对登记结算数据接口进行相应调整。本文档是关于数据接口和D-COM业务终端变动使用的说明，旨在帮助结算参与人及其IT供应商及时完成相关技术系统变更。

二、业务说明

（一）业务简介

资金前端控制，是指深交所、中国结算对交易参与人的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过深交所对交易参与人实施前端控制的制度。深交所对以下交易单元按类别实施资金前端控制：

- （一）证券公司用于自营业务的交易单元；
- （二）证券公司实行托管人结算的资产管理业务的交易单元；
- （三）基金管理公司等机构持有或租用的交易单元；

以上三类交易单元的相关业务纳入前端控制范围，关于上述业务由结算参与人接受交易参与人²委托，向我司申报最高额度相关信息³：证券公司为其自营业务直接向我司申报，自行结算的特殊机构（以下简称“特殊机构”）直接向我司申报；

¹ 深市细则为深交所和中国结算联合发布。

² 此处交易参与人指深交所会员及基金公司等非会员机构

³ 最高额度信息经我司校验通过后发送深交所生效，深交所对外揭示最高额度并允许申报自设额度。

结算参与者（即托管人）就证券公司实行托管人结算的资产管理业务，基金管理公司等机构租用交易单元的实行托管人结算的相关业务向我司申报。结算参与者应当对交易参与者申报信息的真实、完整进行事后稽核；具备条件的，应当进行事前核验。

结算参与者应申报的最高额度相关信息具体如下：

适用机构业务	向我司申报方式	最高额度相关信息 ⁴
证券公司自营业务	证券公司直接申报	机构代码、机构名称、控制类别（会员自营）、净资本、最高额度
证券公司实行托管人结算的资产管理业务	托管人为证券公司申报	机构代码、机构名称、控制类别（会员资管）、合计资产总额、最高额度
基金管理公司等机构租用交易单元的实行托管人结算的相关业务	托管人为基金公司等机构申报	机构代码、机构名称、控制类别（机构业务）、合计资产总额、最高额度
自行结算的特殊机构	特殊机构直接申报	

注 1：其中，机构代码、机构名称指深交所交易参与人在深交所的会籍信息。

注 2：根据适用交易参与者业务种类不同，最高额度的类型，即“控制类别”分为会员自营、会员资管、机构业务三种。

最高额度申报成功后将持续有效；需要调整的，则重新申报。日间有效申报时间内可多次申报最高额度，以最后一次有效申报为准。

最高额度的申报及处理分为常规申报和盘中紧急申报两种方式。常规申报的

⁴ 此处指常规申报下最高额度基本信息要求，盘中紧急申报下要求的信息略有调整，详见后文。

最高额度处理为“日间申报，日末生效”。交易参与人的最高额度信息有误或发生重大变化，为避免影响正常交易或风险控制需求，可以通过任意一家结算参与人发起盘中紧急申报。盘中紧急申报的最高额度处理为“日间申报，即时生效”。盘中申报的最高额度优先级高于常规申报形成最高额度（以下简称“常规额度”），即盘中申报最高额度生效后，在撤销前将持续有效，不受常规申报影响。

（二） 常规申报

1. 申报时间

交易日 08:30-15:00

2. 最高额度申报标准

结算参与人申报的最高额度必须符合以下标准：

“会员自营”最高额度⁵=净资本×2.5

“会员资管”最高额度=合计资产总额×1

“机构业务”最高额度=合计资产总额×1

特殊机构适用“机构业务”类，可以按照内部评估确定的可投资于交易所市场的资产规模填报“合计资产总额”，按合计资产总额的1倍确定最高额度。

3. 数据校验标准

我司将对最高额度相关信息进行有效性校验，校验标准如下：

- （1） 校验深交所机构代码是否存在；
- （2） 深交所机构代码与其名称的对应关系是否准确；
- （3） 校验深交所机构代码与控制类别的对应关系是否准确⁶；
- （4） 校验申报的最高额度是否与根据控制类别、净资本/合计资产总额按计算公式得出的理论值一致；

⁵ 计算结果四舍五入保留整数位

⁶ 我司按深交所提供的会员信息进行校验。基金公司以及特殊机构等交易参与人适用“机构业务”，证券公司根据其业务范围适用“会员自营”“会员资管”。

以上任一项校验不通过的，相关申报失败。校验完成后，实时反馈申报处理结果，申报失败的反馈失败原因。

4. 常规额度的生成与发送

常规申报的最高额度相关信息通过有效性校验后，我司对同一交易参与人通过不同结算参与人申报的最高额度信息按控制类别分别汇总，经与阈值上限（当前为 1000 亿元人民币）比较后，按照“超过阈值上限的，按照阈值上限取值”的原则设定交易参与人相应控制类别下的常规额度，于当日申报结束后将上述常规额度等信息发至深交所。

5. 常规额度的撤销与更新

结算参与人如需撤销已申报成功的申报信息（如结算参与人与产品管理人解除托管关系等情况），通过申报“净资本/合计资产总额”、“最高额度”均为 0 表示撤销常规额度申报。由于结算参与人同一日内可为同一交易参与人多次申报最高额度信息，并且我司最终将以最新一次申报为准，结算参与人当日需调整申报额度的，直接重新申报即可，无需撤销后再重新申报。

（三） 盘中紧急申报

盘中紧急申报需提交的最高额度相关信息与常规申报相比增加“是否突破阈值上限、情况说明、参与人联系人名称与电话”，不需申报“合计资产总额”等信息。

1. 申报时间

8:30- 11:00。

2. 数据校验标准

我司将对最高额度相关信息进行有效性校验，校验标准如下：

- (1) 校验深交所机构代码是否存在；
- (2) 深交所机构代码与其名称的对应关系是否准确；

- (3) 机构代码与控制类别对应关系是否准确;
- (4) 盘中申报最高额度数据应高于已有最高额度 (包括当日已成功申报的盘中紧急调整最高额度和目前生效中的盘中紧急调整最高额度);
- (5) 若“是否突破阈值”为否, 最高额度应小于等于阈值; 若“是否突破阈值”为是, 最高额度应大于阈值;
- (6) 应具备情况说明、参与人联系人名称与电话。

以上任一项校验不通过的, 相关申报失败。校验完成后, 实时反馈申报处理结果, 申报失败的反馈失败原因。

3. 最高额度的发送

盘中紧急申报的最高额度数据通过有效性校验后, 将直接设定为交易参与人相应控制类别下的最高额度。我司对盘中紧急申报的数据即时处理并发送深交所 (正常情况下, 校验通过后的数据在 15 分钟内发送完成)。

4. 最高额度的撤销与更新

交易参与人只能通过原申报紧急调整的结算参与人申报撤销与更新。

盘中申报最高额度撤销申报的时间窗口为交易日 08:30 至 15:00 (同常规申报), 指令当日日终生效 (同常规申报)。盘中申报最高额度撤销后, 交易参与人的最高额度恢复为常规额度。

(四) 最高额度信息反馈、查询

每日日终, 深圳分公司按申报来源发送最高额度数据 (含存量数据) 至相应的结算参与人, 包括其所申报的所有当前有效的最高额度。同时, D-COM 系统为结算参与人提供最高额度申报数据的当天记录和历史记录的查询功能。

(五) 其他注意事项

1、结算参与人申报最高额度相关信息后, 关于我司向深交所发送的最高额度相关信息, 交易参与人可以通过深交所会员业务专区查询。

- 2、结算参与人为交易参与人进行最高额度盘中紧急申报撤销的，该交易参与人之前必须进行最高额度常规申报。
- 3、结算参与人除通过 D-COM 业务终端进行申报外，还可以通过 XML 实时报文接口与我司登记结算系统对接的方式进行申报。
- 4、本指南中净资本、合计资产总额、最高额度的申报单位均为百万元（人民币）且为整数。

三、D-COM 业务终端调整

D-COM 终端“清算交收”栏目下，新增“证券交易资金前端控制”子栏目，下有五个功能模块：“最高额度常规申报”、“最高额度常规申报查询”、“最高额度盘中紧急申报”、“最高额度盘中紧急申报查询”、“最高额度盘中紧急申报撤销”。

四、接口调整

（一）SJSFW 接口调整

SJSFW.DBF 为结算公司发送的综合服务库，具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范》。本次变更在 SJSFW 中增加业务类别为‘21’以及‘22’的两类数据，分别表示“资金前端风险控制最高额度常规申报”数据、“资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报”数据。详细说明如下：

字段名	业务类别	
	资金前端风险控制最高额度常规申报	资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报
FWSJLB	‘21’	‘22’
FWJSZH		
FWBFZH		
FWTGDY		
FWZQDM	机构代码（左对齐右补空格）	机构代码（左对齐右补空格）
FWZQZH	结算参与人编码（左对齐右补空格）	结算参与人编码（左对齐右补空格）
FWGFXZ	控制类别：	控制类别：

字段名	业务类别	
	资金前端风险控制最高额度常规申报	资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报
	'ZY': 会员自营 'ZG': 会员资管 'QT': 机构业务 (左对齐右补空格)	'ZY': 会员自营 'ZG': 会员资管 'QT': 机构业务 (左对齐右补空格)
FWLTLX		
FWMRJE	净资本, 单位为百万元 (人民币)	
FWMCJE	合计资产总额, 单位百万元 (人民币)	
FWZJYE	最高额度, 单位百万元 (人民币)	最高额度, 单位百万元 (人民币)
FWSL1		
FWSL2		
FWCLRQ	申报日期	申报日期
FWFSRQ	发送日期	发送日期
FWZYSM	机构名称 (左对齐右补空格)	机构名称 (左对齐右补空格)
FWBZSM		
FWBYBZ		

补充说明:

结算参与人所申报的所有当前有效的最高额度 (包括历史存量数据) 通过本接口下发, 申报日期为该条有效记录的申报日期, 发送日期为当天。

(二) SJSJG 接口调整

SJSJG.DBF 为结算公司向结算参与人发送的各类明细结果, 具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范》。本次变更在 SJSJG 中增加业务类别为 'ZJQ0'、'ZJQ1' 和 'ZJQ2' 三类数据, 分别表示“资金前端风险控制最高额度常规申报”数据、“资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报”数据和“资金前端风险控制最高额度盘中撤销”数据。详细说明如下:

字段名	业务类别		
	资金前端风险控制最高额度常规申报	资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报	资金前端风险控制最高额度盘中申报撤销

字段名	业务类别		
	资金前端风险控制最高额度常规申报	资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报	资金前端风险控制最高额度盘中申报撤销
JGJSZH			
JGBFZH			
JGSJLX	'01'	'01'	'01'
JGYWLB	'ZJQ0'	'ZJQ1'	'ZJQ2'
JGZQDM	机构代码（左对齐，右补空格）	机构代码（左对齐，右补空格）	机构代码（左对齐，右补空格）
JGJYDY			
JGTGDY			
JGZQZH	结算参与人编码（左对齐，右补空格）	结算参与人编码（左对齐，右补空格）	结算参与人编码（左对齐，右补空格）
JGDDBH			
JGYYB			
JGZXBH			
JGYWLSH	当日报单的业务流水号	当日报单的业务流水号	当日报单的业务流水号
JGCJSL			
JGQSSL			
JGJSSL			
JGCJJG			
JGQSJG			
JGXYJY			
JGPCBS			
JGZQLB			
JGZQZL			
JGGFXZ	控制类别： 'ZY': 会员自营 'ZG': 会员资管 'QT': 机构业务 （左对齐，右补空格）	控制类别： 'ZY': 会员自营 'ZG': 会员资管 'QT': 机构业务 （左对齐，右补空格）	控制类别： 'ZY': 会员自营 'ZG': 会员资管 'QT': 机构业务 （左对齐，右补空格）
JGLTLX			
JGJSFS			
JGHBDH	RMB	RMB	RMB
JGQSBJ	净资本，单位百万元 （人民币）		
JGYHS			

字段名	业务类别		
	资金前端风险控制最高额度常规申报	资金前端风险控制最高额度盘中紧急申报	资金前端风险控制最高额度盘中申报撤销
JGJYJSF			
JGJGGF			
JGGHF			
JGJSF			
JGSXF			
JGQSYJ			
JGQTFY			
JGZJJE	合计资产总额, 单位百万元 (人民币)		
JGSFJE	最高额度, 单位百万元 (人民币)	最高额度, 单位百万元 (人民币)	
JGJSBZ			
JGZYDH			
JGCJRQ	申报日期 CCYYMMDD	申报日期 CCYYMMDD	申报日期 CCYYMMDD
JGQSRQ			
JGJSRQ			
JGFSRQ	发送日期 CCYYMMDD	发送日期 CCYYMMDD	发送日期 CCYYMMDD
JGQTRQ			
JGSCDM			
JGJYFS			
JGZQDM2			
JGTGDY2			
JGDDBH2			
JGFJSM	申报时间 HHMMSS (左对齐, 右补空格)	申报时间 HHMMSS (左对齐, 右补空格)	申报时间 HHMMSS (左对齐, 右补空格)
JGBYBZ			

补充说明:

- (1) 结算参与人当日成功申报最高额度的处理结果通过本接口下发, 申报日期字段为当天; 若当日多次成功申报, 处理结果均会通过本接口下发。
- (2) 当JGYWLB = 'ZJQ0'时表示“资金前端风险控制最高额度常规申报”; 当净资本、合计资产总额、最高额度均为0时, 表示该结算参与人撤销

之前为该交易参与人申报的相应控制类别的最高额度常规申报数据, 该申报的处理结果仅通过SJSJG下发, 不再在SJSFW接口中体现。

(三) XML 实时报文接口调整

《深市登记结算 XML 实时报文接口规范 (Ver 1.1)》增加了“新增交易资金前端控制业务接口”部分, 具体详见附件二。

D-COM 业务终端已经包含了 XML 接口提供的功能, 如果使用新版 D-COM 业务终端, 结算参与人不需要开发相关功能。

五、联系方式

技术咨询电话: 0755-25946080

业务咨询电话: 0755-21899208

邮箱: zychen@chinaclear.com.cn

QQ 群:

91355646 (深市结算技术券商群)

345221331 (深市结算基金银行群)

137835879 (深市结算业务开发商)