

中国证券登记结算公司上海分公司文件

中国结算沪业字〔2019〕50号

关于发布《科创板登记结算技术实施指引 (技术开发稿 1.2 版)》的通知

各结算参与机构:

为确保科创板登记结算的顺利开展,现发布《科创板登记结算技术实施指引(技术开发稿 1.2 版)》。请各结算参与机构务必高度重视,按照技术实施指引尽快做好技术系统开发,积极参与后续市场测试和全网测试等技术准备工作。

技术咨询电话: 021-68872966

技术咨询邮箱: jhan@chinaclear.com.cn

特此通知。

附件:《科创板登记结算技术实施指引(技术开发稿 1.2 版)》

二〇一九年五月六日

附件

科创板登记结算技术实施指引 (技术开发稿1.2版)



中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

二〇一九年四月

版本修订历史

更新日期	最新版本	修订说明
2019/1/29	1.0	形成科创板登记结算技术实施指引（技术开发稿 1.0 版）
2019/3/8	1.1	配合科创板新股网下配售佣金业务，修订新股网下发行获配清算文件（wxsgqs.dbf、wxsgqsXXXXX.dbf）和配售对象资金数据文件（psdxzjsj.dbf）的填写说明。 修订“流通类型”字段数据字典。
2019/4/29	1.2	配合科创板转融券实时交易业务、科创板战略配售股份业务，以及科创板 CDR 业务，修订结算明细文件（jsmx）、证券变动文件（zqbd）、证券余额对账文件（zqye）、其他数量对账文件（qtsl）、业务回报文件（ywhb）的填写说明。

接入平台

结算参与机构通过 PROP 系统与中国结算上海分公司结算系统对接。

日终数据文件

科创板日终登记结算数据通过现有 A 股日终登记结算数据文件发送。结算参与机构通过 PROP 综合业务终端或信箱文件交换工具下载科创板业务日终登记结算数据文件。

实时数据申报

科创板相关实时数据通过 PROP 综合业务终端或者 PROP 通用数据接口申报、查询。

接口调整说明

科创板登记结算涉及科创板普通交易、科创板大宗交易、科创板盘后交易、非交易过户、质押、冻结、转融通、融资融券、网上网下发行、权益发放等业务。

涉及实时数据变化主要如下：

预清算结果查询实时接口中包含科创板日间交易预清算数据。

涉及日终数据文件变化主要如下：

1. 结算明细批次文件中新增业务类型：‘037’（科创板无限售流通股交易），新增清算标志：‘061’（科创板交易清算）。

2. 新股网下发行获配清算文件（ wxsgqs.dbf 、 wxsgqsXXXXX.dbf ）中启用“BY”字段，填写网下配售佣金费率，修订“JE”字段，由获配金额改为应缴金额。
3. 配售对象资金数据文件（ psdxzjsj ）增加科创板股票及存托凭证相关说明。
4. 科创板限售流通股通过证券类别“PT”标识，限售流通股通过证券类别“XL”标识。特别表决权股份通过证券类别“XL”，流通类型“G”标识。战略配售股份通过证券类别“XL”，流通类型“H”标识。
5. 证券变动文件（ zqbd ）新增7个变动类型：“201：科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入”“202：科创板转融券实时交易证金融出”“203：科创板转融券实时交易证金融出自营”“204：科创板战略配售股份转融券实时交易证金融入”“205：科创板战略配售股份转融券非实时证金融入”“206：科创板战略配售股份转融券证金融入归还”“207：证金公司科创板战略配售股份补偿支付”。
6. 业务回报文件（ ywhb ）新增5个业务类型：“431：科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入”“432：科创板转融券实时交易证金融出”“433：科创板转融券实时交易证金融出自营”“434：科创板战略配售股份转融券实时交易证金融入”“435：科创板战略配售股份转融券非实时证金融入”。对于业务类型“416：转融通非实时证券划转”的补

充说明字段新增2个订单类型：“631：科创板战略配售股份转融券证金融入归还”“681：证金公司科创板战略配售股份补偿支付”。

7. 其他数量对账文件（qts1）新增数据类型“021：科创板战略投资者配售股份数量”。

8. 《登记结算数据接口规范（结算参与人版）》中“创新企业发行存托凭证业务”章节调整为“存托凭证业务”，适用于科创板存托凭证和创新企业发行存托凭证业务。

如无特殊说明，现有A股登记结算数据接口适用于科创板股票及存托凭证；科创板股票接口适用于科创板存托凭证。

数据接口文档

（一）结算参与机构数据接口清单

1. 实时接口

服务域	服务名	服务时间	服务类型	说明	服务对象	修改说明
SSCCRC	PROP_QRY	每个交易日 14:15-19:00	04	预清算结果查询	结算参与人	修改

2. 文件清单

前缀	说明	修改说明
jsmx02	结算明细第二批次文件	修改填写说明:增加科创板普通交易填写说明,新增业务类型、清算标志。
jsmx03	结算明细第三批次文件	修改填写说明:增加科创板大宗交易清算、盘后交易清算填写说明;增加CDR盘后交易填写说明
zqbd	证券变动文件	修改填写说明,增加科创板转融券实时交易、科创板战略配售股份相关说明
zqye	证券余额文件	修改填写说明,增加科创板相关说明,增加科创板战略配售股份相关说明
ywhb	业务回报文件	修改填写说明,增加科创板转融券实时交易、科创板战略配售股份相关说明
qtsl	其他数量对账文件	修改填写说明,增加科创板战略投资者配售股份数量。
wxsgqs	新股网下发行获配清算文件(主承销商)	修改填写说明,启用备用字段填写科创板股票网下配售佣金费率,增加科创板相关说明
wxsgqsXXXXX	新股网下发行获配清算文件(托管银行)	修改填写说明,启用备用字段填写科创板证券网下配售佣金费率,增加科创板相关说明
psdxzjsj	配售对象资金数据文件	修改填写说明,增加科创板相关说明

(二) 数据接口规范填写说明

前言-基本数据说明

- 1、股票的数量单位为“股”、基金和权证的数量单位为“份”;债券、融券数量单位为“一元”面值数量;金额单位为“元”。债券类业务中的百元价(含百元结算价)为每百元面值债券价格;对于采取减少面值方式分期偿还的债券,为减少后的面值所对应债券价格。
- 2、所有的日期格式为:YYYYMMDD,时间格式为:HHMMSS。
- 3、在本规范中,如在数据填写说明中出现‘#’,表明该字段的内容对此类数据记录无意义。
- 4、常用数据字典说明见附录。
- 5、如无特别说明,本接口规范中所称“非担保交收”指“采用逐笔全额结算的交收方式”。
- 6、A股指包括人民币普通股票(包括沪市主板、科创板股票)、优先股、债券、基金、权证、存托凭证等。
- 7、对于结算参与人向我公司上传的文件,我司系统不处理已标注删除标志的数据记录。

1. 预清算结果查询

ServiceDomain = “SSCCRC ”

ServiceName = “PROP_QRY ”

接口状态: 已启用

ServiceType = “04”

请求文件:

NO	字段名	类型	长度	说明
1	BFJZH	Character	18	结算备付金账户(必填字段)
	合计		18	

应答文件:

序号	字段名	类型	长度	说明
1	RQ	Character	8	日期
2	JZSJ	Character	6	统计截至时间
3	QSBH	Character	5	清算编号
4	BFJZH	Character	18	备付金账户
5	JBJE	Character	17	净买金额(单位:元,2位小数)
6	JSJE	Character	17	净卖金额(单位:元,2位小数)
7	QSJE	Character	17	清算金额(单位:元,2位小数)
8	JGDM	Character	4	结果代码
9	JGSM	Character	40	结果说明
	合计		132	

说明:

(1) 预清算统计数据只统计以下净额结算品种: 沪市主板普通股票交易、科创板日间交易、CDR交易、优先股交易、封闭基金交易、ETF二级市场交易、LOF(分级)基金交易、债券交易(包括国债、企债、可转债、公司债、政策性金融债、地方政府债等债券交易)、认购权证交易、认沽权证交易、质押式回购清算、买断式回购清算(不含保证金)、国债场内分销,以及债券质押式回购清算、纳入净额结算的ETF现金替代、配股、隔夜买断式购回、报价系统债券交易。

(2) 预清算统计数据不包含A股(包括沪市主板、科创板)大宗交易,不包含科创板(股票及CDR)盘后交易,不包含四费在内的各项费用。

(3) 统计截至时间: 预清算统计时最大成交编号对应的交易成交时间。

(4) 若查询成功,返回数据为结算备付金帐户名下所有清算编号的预清算统计数据。若查询失败,则返回数据中清算编号、净买金额、净卖金额、清算金额为空,失败原因见“结果代码”和“结果说明”。

(5) 结果代码和结果说明如下表所示:

结果代码	结果说明
0000	成功
0331	备付金帐户不能为空
0332	备付金帐户与申报网点不对应
0333	备付金帐户非法

(6) 第一批次预清算结果的可查询时间为 14:30, 第二批次预清算结果的可查询时间为 15:30 左右, 第三批次预清算结果的可查询时间视当日闭市后上海证券交易所交易数据发送我公司的时间而定, 一般为 15:45 左右。

2. jsmx02(结算明细第二批次文件)

- 1) 文件名称: jsmx02-XXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括竞价平台二级市场交易数据
- 3) 文件生成单位: 清算编号
- 4) 发送目标: 结算参与者信箱
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后
- 6) 发送周期: 每个交易日
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式, 数据接口格式定义同jsmx01-XXXXX.mdd
- 9) 数据说明:

本文件包括沪市主板股票交易(含公开发行优先股)、科创板普通交易、CDR交易、债券交易(含担保交收的现券交易和债券场内分销)、基金交易、债券质押式回购/购回等业务的清算数据。

关于本文件包含的具体业务以及各业务的数据填写说明请参见第四章。

3. jsmx03(结算明细第三批次文件)

- 1) 文件名称: jsmx03-XXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括非担保业务的交收结果和第一、二批次未发送的其它清算数据
- 3) 文件生成单位: 清算编号
- 4) 发送目标: 结算参与者信箱
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后
- 6) 发送周期: 每个交易日
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式, 数据接口格式定义同jsmx01-XXXXX.mdd
- 9) 数据说明:

本文件包括RTGS交收结果、新股/可转债/可交换债的中签/弃配/交收、T+0非担保交收结果(报价回购、股票质押式回购等)、T+1非担保交收通知/结果、风控清算(待交收、待处置、欠库扣款/还款、保证金等)、红利清算、债券兑付、兑息、债券质押式回购出入库、非交易费用清算(质押费、查询费、非交易过户费等)、手工划付、非公开发行优先股、权证行权、

可转债转股、沪市主板大宗交易、科创板股票大宗交易、CDR大宗交易、科创板股票盘后交易、CDR盘后交易、ETF申购/赎回（单市场）、ETF申购/赎回（跨市场）、国债预发行、网上申购（现金申购）、CDR跨境转换生成/兑回清算数据，CDR存托服务费清算数据、GDR基础证券过户清算数据等。

4. 结算明细批次文件填写说明：

科创板业务涉及科创板普通交易、大宗交易和盘后交易，中国结算进行日终净额担保交收。

1) YWLX（业务类型）：

‘037’（科创板无限售流通股交易）

‘036’（CDR 交易）

‘360’（CDR 存托服务费资金清算）

2) QSBZ（清算标志）：

‘061’（科创板交易清算）

‘069’（CDR 交易清算）

‘C01’（CDR 存托服务费）

字段名	长度	说明	科创板股票普通交易结算明细	科创板股票大宗交易结算明细	科创板股票盘后交易结算明细
SCDM	2	市场代码	01	01	01
JLLX	3	记录类型	001（清算明细）	001（清算明细）	001（清算明细）
JYFS	3	交易方式	001（普通交易）	002（大宗交易）	104（综合业务平台交易）
JSFS	3	交收方式	001（担保交收）	001（担保交收）	001（担保交收）
YWLX	3	业务类型	037（科创板无限售流通股交易）	037（科创板无限售流通股交易）	037（科创板无限售流通股交易）
QSBZ	3	清算标志	061（科创板交易清算）	061（科创板交易清算）	061（科创板交易清算）
GHLX	3	过户类型	00A	00A	00A
JSBH	16	交收编号	交收编号	交收编号	交收编号
CJBH	16	成交编号	*	*	*
SQBH	16	申请编号	*	*	*
WTBH	16	委托编号	#	#	#
JYRQ	8	交易日期	T 日	T 日	T 日
QSRQ	8	清算日期	T 日	T 日	T 日
JSRQ	8	交收日期	T+1 日	T+1 日	T+1 日
QTRQ	8	其它日期	#	#	#
WTSJ	6	委托时间			
CJSJ	6	成交时间			
XWH1	5	业务单元 1	交易单元	交易单元	交易单元
XWH2	5	业务单元 2	结算单元	结算单元	结算单元
XWHY	8	业务单元 1 所属结	交易单元所属结算参与人的清算编号	交易单元所属结算参与人的清算编号	交易单元所属结算参与人的清算编号

		算参与人的清算编号			
JSHY	8	结算参与人的清算编号	结算单元所属结算参与人的清算编号	结算单元所属结算参与人的清算编号	结算单元所属结算参与人的清算编号
TGHY	8	托管银行的清算编号	空/QFII 托管银行的清算编号	空/QFII 托管银行的清算编号	空/QFII 托管银行的清算编号
ZQZH	10	证券账号	*	*	*
ZQDM1	6	证券代码1	*	*	*
ZQDM2	6	证券代码2	#	#	#
ZQLB	2	证券类别	PT	PT	PT
LTLX	1	流通类型	0	0	0
QYLB	2	权益类别	权益类别	权益类别	权益类别
GPNF	4	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份
MMBZ	1	买卖标志	B/S	B/S	B/S
SL	16	交收数量	实际交收数量	实际交收数量	实际交收数量
CJSL	16	成交数量	交易记录中的成交数量	交易记录中的成交数量	交易记录中的成交数量
ZJZH	25	资金账号	结算备付金账号	结算备付金账号	结算备付金账号
BZ	3	币种	RMB	RMB	RMB
JG1	17	价格1	交易成交价格	交易成交价格	交易成交价格
JG2	17	价格2	交易成交价格	交易成交价格	交易成交价格
QSJE	19	清算金额	ABS(成交数量×价格1)×收付方向 买方:收付方向为:-1 卖方:收付方向为:+1	ABS(成交数量×价格1)×收付方向 买方:收付方向为:-1 卖方:收付方向为:+1	ABS(成交数量×价格1)×收付方向 买方:收付方向为:-1 卖方:收付方向为:+1
YHS	17	印花税	印花税	印花税	印花税
JSF	17	经手费	经手费	经手费	经手费
GHF	17	过户费	过户费	过户费	过户费
ZGF	17	证管费	证管费	证管费	证管费
SXF	17	手续费	手续费	手续费	手续费
QTJE1	19	其它金额1	0.00	0.00	0.00
QTJE2	19	其它金额2	0.00	0.00	0.00
QTJE3	19	其它金额3	0.00	0.00	0.00
SJSF	19	实际收付	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用
JGDM	4	结果代码	0000	0000	0000
FJSM	40	附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志的附加说明

字段名	长度	说明	CDR 普通交易 结算明细说明	CDR 大宗交易结算 明细	CDR 盘后交易 结算明细	CDR 存托服务 费清算数据
SCDM	2	市场代码	01	01	01	01
JLLX	3	记录类型	001 (清算明 细)	001 (清算明 细)	001 (清算明 细)	001 (清算明 细)
JYFS	3	交易方式	001 (普通交 易)	002 (大宗交易)	104 (综合业务 平台交易)	003 (非交易)
JSFS	3	交收方式	001 (担保交 收)	001 (净额担保)	001 (担保交 收)	001 (净额担 保)
YWLX	3	业务类型	036(CDR 交易)	036 (CDR 交易)	036(CDR 交易)	360 (CDR存托 服务费资金清 算)
QSBZ	3	清算标志	069 (CDR 交易 清算)	069 (CDR 交易清 算)	069 (CDR 交易 清算)	C01 (CDR存托 服务费)
GHLX	3	过户类型	00A	00A 交易过户	00A 交易过户	#
JSBH	16	交收编号		*	*	交收编号
CJBH	16	成交编号	*	*	*	#
SQBH	16	申请编号	*	*	*	#
WTBH	16	委托编号		*	*	
JYRQ	8	交易日期	T 日	T 日	T 日	存托服务费计 费起始日期 (T-1 日)
QSRQ	8	清算日期	T 日	T 日	T 日	T 日
JSRQ	8	交收日期	T+1 日	T+1 日	T+1 日	T+1 日
QTRQ	8	其它日期	#	#	#	存托服务费计 费截止日期 (T 日的上一自然 日)
WTSJ	6	委托时间				
CJSJ	6	成交时间				
XWH1	5	业务单元 1	交易单元	交易单元	交易单元	#
XWH2	5	业务单元 2	结算单元	结算单元	结算单元	结算单元
XWHY	8	业务单元 1 所属结 算参与人 的清算编 号	交易单元所属 结算参与人 的清算编 号	交易单元所属 结算参与人 的清算编 号	交易单元所属 结算参与人 的清算编 号	交易单元所属 结算参与人 的清算编 号
JSHY	8	结算参与 人的清算 编号	结算单元所属 结算参与人 的清算编 号	结算单元所属 结算参与人 的清算编 号	结算单元所属 结算参与人 的清算编 号	结算单元所属 结算参与人 的清算编 号
TGHY	8	托管银行 的清算编 号	空/QFII 托管 银行的清算编 号	空/QFII 托管银 行的清算编 号	空/QFII 托管 银行的清算编 号	空/QFII 托管 银行的清算编 号
ZQZH	10	证券账号	*	*	*	证券账户
ZQDM1	6	证券代码 1	*	*	*	CDR 代码
ZQDM2	6	证券代码		#	#	#

		2				
ZQLB	2	证券类别	PT	PT	PT	#
LTLX	1	流通类型	0	0	0	#
QYLB	2	权益类别				#
GPNF	4	挂牌年份				#
MMBZ	1	买卖标志	B/S	B/S	B/S	#
SL	16	交收数量	实际交收数量	实际交收数量	实际交收数量	T-1 日日终持有数量
CJSL	16	成交数量	交易记录中的成交数量	交易记录中的成交数量	交易记录中的成交数量	#
ZJZH	25	资金账号	结算备付金账号	结算备付金账号	结算备付金账号	结算备付金账号
BZ	3	币种	RMB	RMB	RMB	RMB
JG1	17	价格 1	交易成交价格	交易成交价格	交易成交价格	#
JG2	17	价格 2	交易成交价格	交易成交价格	交易成交价格	#
QSJE	19	清算金额	ABS (成交数量 × 价格 1) × 收付方向 买方: 收付方向为: -1 卖方: 收付方向为: +1	ABS (成交数量 × 价格 1) × 收付方向	ABS (成交数量 × 价格 1) × 收付方向	#
YHS	17	印花税	印花税	印花税	印花税	0.00
JSF	17	经手费	经手费	经手费	经手费	0.00
GHF	17	过户费	过户费	过户费	过户费	0.00
ZGF	17	证管费	证管费	证管费	证管费	0.00
SXF	17	手续费	手续费	手续费	手续费	0.00
QTJE1	19	其它金额 1	0.00	0.00	0.00	存托服务费
QTJE2	19	其它金额 2	0.00	0.00	0.00	0.00
QTJE3	19	其它金额 3	0.00	0.00	0.00	0.00
SJSF	19	实际收付	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用	清算金额加各项费用
JGDM	4	结果代码	0000	0000	0000	0000
FJSM	40	附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志的附加说明	同清算标志说明

普通二级市场交易业务包括：**沪市主板**无限售流通股交易、封闭基金交易、国债交易、企债交易、配股交易、股配债交易、职工股配股交易交易、上证 LOF (分级基金) 交易、**CDR 交易**、互联互通 CDR 无限售流通股交易和**科创板无限售流通股交易**等。

YWLX (业务类型) :

- “001” **沪市主板**无限售流通股交易
- “002” 封闭基金交易
- “003” 国债交易
- “004” 企债交易
- “012” 担保类配股配债

- “013” 职工股配股交易
- “022” 国债场内分销
- “034” 上证LOF（分级基金）交易
- “036” CDR交易
- “037” 科创板限售流通股交易

5. zqbd(证券变动文件)

- 1) 文件名称: zqbdXXXXX.mdd (XXXXX为清算编号)
- 2) 数据内容: 包含当日证券账户中各类证券及权益的变动数据。对于QFII账户, 数据同时发送至QFII托管银行
- 3) 文件生成单位: 清算编号
- 4) 发送目标: 结算参与人PROP信箱
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后
- 6) 发送周期: 每个交易日
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		托管会员的清算编号, 对于QFII账户, 填写托管银行的清算编号
3	ZQZH	Character	10		证券账户
4	XWH	Character	5		交易单元
5	ZQDM	Character	6		证券代码
6	ZQLB	Character	2		证券类别
7	LT LX	Character	1		流通类型
8	QYLB	Character	2		权益类别
9	GPNF	Character	4		挂牌年份
10	BDSL	Character	16	±9999999999999999	变动数量
11	BDLX	Character	3		变动类型
12	BDRQ	Character	8		变动日期
13	SL	Character	16	±9999999999999999	数量(保留字段)
14	BH	Character	20		编号(保留字段)
15	BY	Character	20		备用

- 9) 数据说明:
 - (1) 包括所有流通股份的变动, 但不包括法人股、国家股等非流通股份的变动。
 - (2) 变动数量单位, 股票(含沪市主板、科创板)单位为“股”, CDR、基金和权证为“份”, 记账式债券为“元”。
 - (3) 交易单元, 指变动发生的交易单元。
 - (4) 对于融资类信用交易业务, 本文件仅提供客户信用证券账户的变动数据, 不提供证券公司客户信用交易担保证券账户的相关数据, 即数据中的证券账户(ZQZH)填写客户信用证券账户, 不再填写客户信用交易担保证券账户, 备用(BY)字段填空。

(5) 变动类型 (BDLX) :

新增科创板转融通业务变动类型。

201: 科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入

202: 科创板转融券实时交易证金融出

203: 科创板转融券实时交易证金融出自营

204: 科创板战略配售股份转融券实时交易证金融入

205: 科创板战略配售股份转融券非实时证金融入

206: 科创板战略配售股份转融券证金融入归还

207: 证金公司科创板战略配售股份补偿支付

6. zqye (证券余额对账文件)

- 1) 文件名称: zqyeXXXXX.mdd (XXXXX为清算编号)。
- 2) 数据内容: 包含当日日终证券账户的各类证券余额信息。对于QFII账户, 数据同时发送至QFII托管银行。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

NO	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		托管会员的清算编号, 对于 QFII 账户, 填写托管银行的清算编号
3	ZQZH	Character	10		证券账户
4	XWH	Character	5		指定交易单元
5	ZQDM	Character	6		证券代码
6	ZQLB	Character	2		证券类别
7	LTLX	Character	1		流通类型
8	QYLB	Character	2		权益类别
9	GPNF	Character	4		挂牌年份
10	YE1	Character	16	±9999999999999999	余额 1 (全部余额)
11	YE2	Character	16	±9999999999999999	余额 2 (冻结证券数量, 含权利受限登记部分)
12	BY	Character	12		备用
13	JZRQ	Character	8		截止日期

9) 数据说明:

(1) 本文件包含所有指定交易证券账户的余额数据, 包括无限售流通股、限售流通股(含战略配售股份)、非流通股以及各类权益数据。

(2) 余额 1 字段的内容为证券账户持有某证券品种的全部余额,包括被冻结部分的余额。

(3) 余额 2 字段的数量,包括证券冻结和因报送不限制卖出冻结信息而引起的权利受限登记两部分,为两部分的总量合计。本字段不体现账户冻结信息。

(4) 本文件仅提供客户信用证券账户的余额数据,不提供证券公司客户信用交易担保证券账户的相关数据,即数据中的证券账户(ZQZH)填写客户信用证券账户,不再填写客户信用交易担保证券账户,备用(BY)字段填空。

(5) 股票(含沪市主板、科创板)余额的数量单位为“股”; CDR、基金和权证余额的数量单位为“份”;记账式债券余额的数量单位为“元”。

(6) 如证券账户为转融通担保证券账户,则余额记录中BY字段内容为转融通担保证券明细账户。

7. ywhb(业务回报文件)

- 1) 文件名称: ywhb.mdd。
- 2) 数据内容: 包含各类登记结算业务的回报数据,如通过PROP系统申报的各类业务回报数据。
- 3) 文件生成单位: 结算参与者信箱。
- 4) 发送目标: 结算参与者 PROP 信箱。
- 5) 发送时间: 日终处理后。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 接口状态: 已启用。
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式:

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	QSBH	Character	8		结算会员的清算编号
3	YWLX	Character	3		业务类型
4	YWLY	Character	2		业务来源
5	SBLX	Character	2		申报类型
6	JGDM	Character	4		结果代码
7	JGSM	Character	40		结果说明
8	SLBH	Character	20		受理编号
9	YWBH	Character	20		业务编号
10	SBBH	Character	20		申报编号
11	YHDM	Character	8		用户代码
12	SBRQ	Character	8		申报日期
13	SBSJ	Character	6		申报时间
14	ZQDM	Character	6		证券代码
15	ZQLB	Character	2		证券类别
16	LT LX	Character	1		流通类型
17	QYLB	Character	2		权益类别
18	GPNF	Character	4		挂牌年份
19	FZDM	Character	10		辅助代码
20	ZQZH1	Character	10		证券账户 1

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
21	ZQZH2	Character	10		证券账户 2
22	XWH1	Character	5		业务单元 1
23	XWH2	Character	5		业务单元 2
24	SBSL	Character	16	±9999999999999999	申报数量
25	CGSL	Character	16	±9999999999999999	成功数量
26	BCYE	Character	16	±9999999999999999	本次余额
27	JE1	Character	19	±9999999999999999.99	金额 1
28	JE2	Character	19	±9999999999999999.99	金额 2
29	RQ	Character	8		日期
30	BCSM	Character	40		补充说明

9) 数据说明:

(1) YWLX: 定义业务回报数据的类型, 定义如下:

125: CDR 跨境转换生成 (仅发存托人和跨境转换机构)

126: CDR 跨境转换兑回 (仅发存托人和跨境转换机构)

127: GDR 生成基础证券过户 (仅发 GDR 存托人和开展跨境转换业务的境外证券经营机构的结算参与者)

128: GDR 兑回基础证券过户 (仅发 GDR 存托人和开展跨境转换业务的境外证券经营机构的结算参与者)

302: 股权激励期权行权申报回报数据 391: 最高额度明细回报数据

401: 国债回购登记回报数据 402: 挂失转户/销户申报受理回报数据

403: 放弃认购按市值配售中签新股明细数据处理结果回报数据

404: 上市公司要约收购预受要约及债券回售申报处理结果回报数据

405: 质押合约申报回报数据 406: 冻结流通证券回报数据

408: (跨市场转登记) 补登记回报数据

412: 融资融券成交回报数据

413: 通过交易系统提交的证券划转申报的回报数据

414: 客户信用证券账户 PROP 销号申报的回报数据

415: 国债跨市场转托管回报数据

416: 转融通非实时证券划转

417: 转融通担保品证券划转

419: 股息红利差异化计税补缴

431: 科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入

432: 科创板转融券实时交易证金融出

433: 科创板转融券实时交易证金融出自营

434: 科创板战略配售股份转融券实时交易证金融入

435: 科创板战略配售股份转融券非实时证金融入

461: 证券变动查询回报数据

462: 证券余额查询回报数据

467: 无指定交易证券账户持有查询回报数据

654: 创新创业可转债转股回报数据

(2) YWLY 定义如下:

01: 交易系统 02: PROP 申报
03: 前台受理 99: 其他

(3) 结果代码“0000”为成功,其余为失败,结果说明是对结果代码的说明。

(4) 融资融券成交回报数据的融资融券标签,定义如下:

1: 担保品买入 2: 担保品卖出 3: 融资买入 4: 卖券还款
5: 买券还券 6: 融券卖出 7: 融券平仓 8: 融资平仓

(5) 关于辅助代码:

当 YWLX 为 413 时,辅助代码代表过户原因,定义如下:

G: 担保品划转(799983) H: 券源划转(799984)
I: 还券划转(799982) J: 余券划转(799981)

当 YWLX 为 416 时,辅助代码(前 3 位)代表过户类型,取值范围是
110/111/112/113/114/115;

当 YWLX 为 417 时,辅助代码(前 3 位)代表过户类型,取值范围是
120/121/122/123/124/125;

以上过户类型的业务描述,参见附录的变动类型(GHLX)部分。

(6) 关于补充说明字段:

当业务类型为 416/417 时,补充说明前 3 位表示订单类型;第 4 位到第 21 位填写对手方结算备付金账户,如果对手方无结算备付金账户则第 4 位到第 21 位填空;第 22 位到第 27 位填写总部参与人代码(总部参与人代码仅供参考),如果无总部参与人代码则第 22 位到第 27 位填空

当业务类型为‘416’时,前 3 位表示转融通证券划转订单类型:

231: 转融券证金融入归还
233: 转融券证金融入
241: 转融券证金融出
242: 转融券证金融出归还
251: 证金公司调帐申报
252: 证券公司调账申报
281: 证金公司证券补偿支付
282: 证券公司证券补偿支付
291: 转融通券源划转

631: 科创板战略配售股份转融券证金融入归还

681: 证金公司科创板战略配售股份补偿支付

当业务类型为‘417’时,前 3 位表示担保品证券划转原因:

311: 担保证券交存
312: 担保证券提取
413: 处置担保证券划出
511: 临时使用担保证券划出
512: 临时使用担保证券划入

513: 临时使用担保证券证券权益补偿归还

10) 数据填写详细说明:

字段名	说明	科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入	科创板转融券实时交易证金融出	科创板转融券实时交易证金融出自营
SCDM	市场代码	'01'	'01'	'01'
QSBH	清算编号	清算编号	清算编号	清算编号
YWLX	业务类型	431: 科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入	432: 科创板转融券实时交易证金融出	433: 科创板转融券实时交易证金融出自营
YWLY	业务来源	01: 交易系统	01: 交易系统	01: 交易系统
SBLX	申报类型	'B' / 'S'	'B' / 'S'	'B' / 'S'
JGDM	结果代码	0000	0000	0000
JGSM	结果说明	过户成功	过户成功	过户成功
SLBH	受理编号	#	#	#
YWBH	业务编号	成交序列号	成交序列号	成交序列号
SBBH	申报编号	#	合约编号	合约编号
YHDM	用户代码	#	#	#
SBRQ	申报日期	当前日期	当前日期	当前日期
SBSJ	申报时间	#	#	#
ZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
ZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别
LTLX	流通类型	流通类型	流通类型	流通类型
QYLB	权益类别	#	#	#
GPNF	挂牌年份	#	#	#
FZDM	辅助代码	过户类型 201: 科创板无限售流通股转融券实时交易证金融入	过户类型 202: 科创板转融券实时交易证金融出	过户类型 203: 科创板转融券实时交易证金融出自营
ZQZH1	证券账户 1	证券账户	证券账户	证券账户
ZQZH2	证券账户 2	对手方证券账户	对手方证券账户	对手方证券账户
XWH1	业务单元 1	指定交易 PBU 单元	指定交易 PBU 单元	指定交易 PBU 单元
XWH2	业务单元 2	#	#	#
SBSL	申报数量	申报数量	申报数量	申报数量
CGSL	成功数量	成功数量	成功数量	成功数量
BCYE	本次余额	#	#	#
JE1	金额 1	#	#	#
JE2	金额 2	#	#	#
RQ	日期	#	#	#
BCSM	补充说明	前 3 位为空, 第 4 位到第 21 位填写对手方结算备付金账户, 如果对手方无结算备付金账户则第 4 位到第 21 位填空; 第 22 位到第 27 位填写总部参与人代码 (仅供参考), 如果无总部参与人代码则第 22 位到第 27 位填空	前 3 位为空, 第 4 位到第 21 位填写对手方结算备付金账户, 如果对手方无结算备付金账户则第 4 位到第 21 位填空; 第 22 位到第 27 位填写总部参与人代码 (仅供参考), 如果无总部参与人代码则第 22 位到第 27 位填空	前 3 位为空, 第 4 位到第 21 位填写对手方结算备付金账户, 如果对手方无结算备付金账户则第 4 位到第 21 位填空; 第 22 位到第 27 位填写总部参与人代码 (仅供参考), 如果无总部参与人代码则第 22 位到第 27 位填空

字段名	说明	科创板战略配售 股份转融券实时 交易证金融入	科创板战略配 售股份转融券 非实时证金融 入	科创板战略配售 股份转融券证金 融入归还	证金公司科创板 战略配售股份补 偿支付
SCDM	市场代码	‘01’	‘01’	‘01’	‘01’
QSBH	清算编号	清算编号	清算编号	清算编号	清算编号
YWLX	业务类型	434: 科创板战略 配售股份转融券 实时交易证金融 入	435: 科创板战 略配售股份转 融券非实时证 金融入	‘416’: 转融通 非实时证券划转	‘416’: 转融通 非实时证券划转
YWLY	业务来源	01: 交易系统	01: 交易系统	02: PROP	02: PROP
SBLX	申报类型	‘B’ / ‘S’	‘B’ / ‘S’	‘B’ / ‘S’	‘B’ / ‘S’
JGDM	结果代码	0000	结果代码	结果代码	结果代码
JGSM	结果说明	过户成功	结果说明	结果说明	结果说明
SLBH	受理编号	#	#	受理编号	受理编号
YWBH	业务编号	成交序列号	成交序列号	#	#
SBBH	申报编号	#	#	原合约编号	原合约编号
YHDM	用户代码	#	#	#	#
SBRQ	申报日期	当前日期	当前日期	当前日期	当前日期
SBSJ	申报时间	#	#	#	#
ZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
ZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别
LTLX	流通类型	流通类型	流通类型	流通类型	流通类型
QYLB	权益类别	#	#	#	#
GPNF	挂牌年份	#	#	#	#
FZDM	辅助代码	过户类型 204: 科创板战略 配售股份转融券 实时交易证金融 入	过户类型 205: 科创板战 略配售股份转 融券非实时证 金融入	过户类型 206: 科创板战略 配售股份转融券 证金融入归还	过户类型 207: 证金公司科 创板战略配售股 份补偿支付
ZQZH1	证券账户 1	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
ZQZH2	证券账户 2	对手方证券账户	对手方证券账 户	对手方证券账户	对手方证券账户
XWH1	业务单元 1	指定交易 PBU 单 元	指定交易 PBU 单元	指定交易 PBU 单 元	指定交易 PBU 单 元
XWH2	业务单元 2	#	#	#	#
SBSL	申报数量	申报数量	申报数量	申报数量	申报数量
CGSL	成功数量	成功数量	成功数量	成功数量	成功数量
BCYE	本次余额	#	#	#	#
JE1	金额 1	#	#	#	#
JE2	金额 2	#	#	#	#
RQ	日期	#	#	#	#
BCSM	补充说明	前 3 位为空, 第 4 位到第 21 位填 写对手方结算备 付金账户, 如果 对手方无结算备 付金账户则第 4 位到第 21 位填 空; 第 22 位到第 27 位填写总部 参与人代码 (仅 供参考), 如果	前 3 位为空, 第 4 位到第 21 位填写对手方 结算备付金账 户, 如果对手 方无结算备付 金账户则第 4 位到第 21 位填 空; 第 22 位到 第 27 位填写总 部参与人代码 (仅供参考),	前三位 631: 科 创板战略配售股 份转融券证金融 入归还; 第 4 位 到第 21 位填写 对手方结算备付 金账户, 如果对 手方无结算备付 金账户则第 4 位 到第 21 位填空; 第 22 位到第 27 位填写总部参与 人代码 (仅供参	前三位为 681: 证 金公司科创板战 略配售股份补偿 支付; 第 4 位到 第 21 位填写对 手方结算备付金 账户, 如果对手 方无结算备付金 账户则第 4 位到 第 21 位填空; 第 22 位到第 27 位填写 总部参与人代码 (仅供参考), 如

8. qts1(证券其他数量对账文件)

- 1) 文件名称: qts1XXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)。
- 2) 数据内容: 包含证券的其他数量信息,例如证券冻结明细数量、证券待交收明细数量、当日退登记证券股份明细数量、证券账户质押券余额、证券账户标准券余额、询价增发保留权数量、当前有效的质押物明细及股权激励期权持有明细数据、证券账户日终“T+1日欠库测算”数据、债券质押式三方回购质押品数量及科创板战略投资者配售股份数据等。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人PROP信箱。
- 5) 发送时间: 每个交易日日终后。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式:

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
1	SCDM	Character	2		市场代码
2	HYDM	Character	8		结算参与人的清算编号
3	SJLX	Character	3		数据类型
4	ZQZH	Character	10		证券账户
5	XWH	Character	5		业务单元
6	ZQDM	Character	6		证券代码
7	ZQLB	Character	2		证券类别
8	LTLX	Character	1		流通类型
9	QYLB	Character	2		权益类别
10	GPNF	Character	4		挂牌年份
11	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量1
12	SL2	Character	16	±9999999999999999	数量2
13	BH1	Character	20		编号1
14	BH2	Character	20		编号2
15	FZDM	Character	3		辅助代码
16	RQ	Character	8		日期
17	BCSM	Character	40		补充说明
18	BY	Character	20		备用

9) 数据说明:

(1) SJLX: 定义证券的其他数量类型,定义如下:

- 001: 冻结(含权利受限登记)证券明细数量
- 002: 待交收证券明细数量
- 005: 跨市场转登记挂账明细数量 006: 当日退登记证券股份明细数量
- 007: 证券账户质押券余额 008: 证券账户标准券余额
- 009: 询价增发保留权数量 010: 权利受限登记数量
- 012: 当前有效的质押物明细 017: 股权激励期权持有明细数量

018: 证券账户日终“T+1日欠库测算”数据

019: 债券质押式三方回购质押品数量

020: 证券锁定明细数量

021: 科创板战略投资者配售股份数据

(2) 对于不同数据类型, 本文件的各字段有不同含义, 具体请参见数据填写详细说明。

(3) 对于当日退登记证券股份明细数据(数据类型为‘006’), 证券帐号为客户信用证券账户, 本文件仅提供客户信用证券账户的余额数据, 不提供证券公司客户信用交易担保证券账户的相关数据, 即数据中的证券账户(ZQZH)填写客户信用证券账户, 不再填写客户信用交易担保证券账户, 备用(BY)字段填空。

(4) 对于当日退登记证券股份明细数据(数据类型为‘006’), 证券帐号为转融通担保证券明细账户, 本文件仅提供转融通担保证券明细账户的余额数据, 不提供转融通担保证券账户的相关数据, 即数据中的证券账户(ZQZH)填写转融通担保证券明细账户, 不再填写转融通担保证券账户, 备用(BY)字段填空。

(5) 当数据类型为‘001’, 且为股票质押式回购明细数据时, 补充说明(BCSM)字段内容为质权人名称, 备用(BY)字段内容为相应的股票质押式回购质押登记编号。

(6) 对于证券账户日终“T+1日欠库测算”数据(数据类型为‘018’), 备用(BY)字段为选填项。如果数量1(SL1)字段大于等于零, 备用(BY)字段填空, 否则备用(BY)字段填“YYYYMMDD可能欠库”(YYYYMMDD为T+1日日期)。

字段名	长度	科创板战略投资者战略配售股份数量
SCDM	2	‘01’
HYDM	8	清算编号
SJLX	3	‘021’
ZQZH	10	证券账户
XWH	5	交易单元
ZQDM	6	证券代码
ZQLB	2	XL
LTLX	1	H
QYLB	2	#
GPNF	4	#
SL1	16	科创板战略投资者战略配售股份数量(不含冻结)
SL2	16	#
BH1	20	#
BH2	20	#
FZDM	3	#
RQ	8	T日
BCSM	40	#
BY	20	#

9. wxsgqs (新股网下发行获配清算文件)

1. 数据库名: wxsgqs.mdd;
2. 数据内容: 新股网下发行获配清算文件;
3. 文件生成单位: 清算编号;

4. 发送目标: 主承销商及联席承销商;
5. 发送时间: T+1日(T日为申购日)日终后;
6. 发送周期: 不定期, 不发空文件;
7. 接口状态: 已启用;
8. 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式;

序号	字段名	类型	长度	说明	填写说明
1	SBBH	Character	20	申报编号	
2	ZQZH	Character	10	证券账户	配售对象报备证券账户
3	ZQDM	Character	6	证券代码	新股网下发行证券的二级市场交易代码
4	SL	Character	16	获配数量	有效获配数量
5	JG	Character	17	获配价格	格式: 9999999.99999999
6	JE	Character	20	应缴金额	格式: 9999999999999999.99 应缴金额=获配金额+佣金。其中, 获配金额=获配数量×获配价格, 四舍五入到分。佣金=获配金额×佣金费率, 四舍五入到分。
7	SGRQ	Character	8	获配日期	格式: YYYYMMDD
8	QSRQ	Character	8	清算日期	格式: YYYYMMDD
9	JGDM	Character	4	结果代码	0000: 正确
10	FJSM	Character	40	附加说明	0000: 正确
11	BY	Character	50	备用	1-6位填写网下配售佣金费率, 左对齐。小数点占用1位, 不足6位右边补0。 举例: 佣金费率为 1.2%, 左边 6 位填写 0.0120 对于沪市主板证券, 佣金费率为 0.0000

10. wxsgqsXXXXX (新股网下发行获配清算文件)

1. 数据库名: wxsgqsXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号);
2. 数据内容: 新股网下发行获配清算文件;
3. 文件生成单位: 清算编号;
4. 发送目标: 托管银行;
5. 发送时间: T+1日(T日为申购日)日终后;
6. 发送周期: 不定期, 不发空文件;
7. 接口状态: 已启用;
8. 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式;

序号	字段名	类型	长度	说明	填写说明
1	SBBH	Character	20	申报编号	
2	ZQZH	Character	10	证券账户	配售对象报备证券账户
3	ZQDM	Character	6	证券代码	新股网下发行证券的二级市场交易代码
4	SL	Character	16	获配数量	有效获配数量
5	JG	Character	17	获配价格	格式: 9999999.99999999
6	JE	Character	20	应缴金额	格式: 9999999999999999.99 应缴金额=获配金额+佣金。其中, 获配金额=获配数量×获配价格, 四舍五入到分。佣金=获配金额×佣金费率, 四舍五入到分。
7	SGRQ	Character	8	获配日期	格式: YYYYMMDD
8	QSRQ	Character	8	清算日期	格式: YYYYMMDD

9	JGDM	Character	4	结果代码	0000: 正确
10	FJSM	Character	40	附加说明	0000: 正确
11	BY	Character	50	备用	1-6位填写网下配售佣金费率，左对齐。小数点占用1位，不足6位右边补0 举例：佣金费率为 1.2%，左边 6 位填写 0.0120 对于沪市主板证券，佣金费率为 0.0000

11. psdxzjsj (配售对象资金数据文件)

1. 数据库名: psdxzjsj.mdd;
2. 数据内容: 包含新股网下发行配售对象配售款、退款数据;
3. 文件生成单位: 清算编号;
4. 发送目标: 主承销商;
5. 发送时间: T+4日(T日为申购日)9:00之前;
6. 发送周期: 不定期, 不发空文件;
7. 接口状态: 已启用;
8. 数据格式: FOXPRO2.5下的标准DBF格式;

序号	字段名	类型	长度	说明
1	SJLX	Character	3	数据类型
2	ZQZH	Character	10	证券账户
3	ZHQC	Character	80	账户全称
4	ZQDM	Character	6	证券代码
5	JE	Character	20	金额 格式: 9999999999999999.99
6	SL	Character	16	数量
7	CLRQ	Character	8	处理日期
8	ZJDM	Character	40	证件代码, 左对齐
9	BY	Character	50	备用

9. 数据说明:

(1) SJLX的定义如下:

002: 配售对象配售款 003: 配售对象退款

(2) “SJLX(数据类型)” + “ZQZH(证券账户)” + “ZQDM(证券代码)” 相同的只出现一条记录。

(3) 对于科创板股票: SJLX(数据类型)为“002(配售对象配售款)”时, JE字段包含网下配售佣金; SJLX(数据类型)为“003(配售对象退款)”时, JE字段=到账金额-配售对象配售款。

10. 数据填写详细说明:

字段名	长度	字段描述	配售对象配售款数据	配售对象退款数据
SJLX	3	数据类型	'002'	'003'
ZQZH	10	证券账户	配售对象报备证券账户	
ZHQC	80	账户全称	配售对象报备证券账户全称	
ZQDM	6	证券代码	网下新股申购证券的二级市场交易代码	
JE	20	金额	配售对象配售款	配售对象退款
SL	16	数量	配售数量	空
CLRQ	8	处理日期	格式:YYYYMMDD	
ZJDM	40	证件代码	空	空
BY	50	备用	保留	

数据字典

流通类型（LTLX）意义如下：

LTLX	说明
0	流通
1	第一次
2	第二次
3	第三次
4	第四次
5	第五次
6	第六次
7	第七次
8	第八次
9	第九次
A	股改股份
B	首次公开发行前股份
C	股权激励股份
D	网下发行新股
E	其他限售股份
F	非公开发行股份
G	特别表决权股份
H	科创板战略投资者配售股份
J	限售或非流通
K	限售或非流通
M	限售或非流通
N	限售或非流通
Q	限售或非流通
T	限售或非流通
Z	限售或非流通

主题词：科创板 登记结算 技术指引 数据接口

抄报：公司总部

上海分公司综合部

2019年5月6日印发

打字：赵亦婷

校对：丁帅

共印1份