



中国结算工程技术文档

工程技术标准

深市股票期权结算数据接口规范

(结算参与人版 Ver 1.00)



中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇一九年十一月

文档信息

文档名称	深市股票期权结算数据接口规范			
编制者	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司技术开发部			
说明	用于深市股票期权结算参与人与中国结算深圳分公司的数据交换			
修订历史 (REVISION HISTORY)				
Rev	Section	Type	Date	Remarks
0.97		修订	2018/6/13	
1.00		修订	2019/11	合并了以下内容： 1. 组合策略保证金、行权指令合并申报功能调整 2. ETF结算模式调整 3. 新增参考信息SQ_CKXX.DBF

目 录

说明.....	3
接口规范.....	3
1. 衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF.....	4
2. 衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF.....	12
3. 衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF.....	12
4. 衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF.....	13
5. 衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF.....	14
6. 资金净额交收库 SQ_ZJJE.DBF.....	15
7. 证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF.....	18
8. 组合持仓明细库 SQ_ZHCC.DBF.....	23
9. 保证金明细库 SQ_BZJMX.DBF.....	24
10. 参考信息库 SQ_CKXX.DBF.....	26
11. 通知文件 SQ_TZWJ.DBF.....	30
12. 广播信息 SQ_GBXX.DBF.....	32
附件一 摘要代号汇编.....	34

深市股票期权结算数据接口规范

说明

本文档用于描述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”）在深市期权业务中对结算参与人的结算数据接口。

中国结算深圳分公司负责对本数据接口进行修订、解释。

接口规范

中国结算深圳分公司每日向结算参与人发送接口文件，接口名后带四位日期信息（MMDD），例如 2019 年 5 月 1 日发送的 SQ_JSMX.DBF，参与人接收到的文件名为 SQ_JSMX0501.DBF。

- 1) 衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF
- 2) 衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF
- 3) 衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF
- 4) 衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF
- 5) 衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF
- 6) 资金净额交收库 SQ_ZJJE.DBF
- 7) 证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF
- 8) 组合持仓明细库 SQ_ZHCC.DBF
- 9) 保证金明细库 SQ_BZJMX.DBF
- 10) 参考信息库 SQ_CKXX.DBF
- 11) 通知文件 SQ_TZWJ.DBF
- 12) 广播信息 SQ_GBXX.DBF

注意，在交易单元权限开通前，结算参与人只能收到 4)、5)、6)、7)、11)、12) 六个文件。

1. 衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF

文件内容：

1. 交易清算。
2. 行权指派。
3. 备兑券不足转普通仓。
4. 交易经手费每日优惠明细（仅对做市商）。
5. 通过交易通道申报业务的失败通知。
6. 行权合并申报成功数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	‘01’=衍生品清算数据 ‘04’=衍生品申报失败通知 ‘05’=衍生品申报处理结果
3	YWLB	业务类别	C	4	‘Q101’=期权交易 ‘Q102’=备兑券不足转普通仓 ‘Q104’=交易经手费优惠（含返还和奖励） ‘Q201’=期权行权 ‘Q206’=转处置券扣划 ‘Q207’=转处置券归还 ‘Q208’=待清偿扣划客户 ‘Q209’=待清偿扣划自营 ‘Q212’=垫券 ‘Q213’=还券 ‘Q215’=认沽期权 E 日转现金结算
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	DDBH	客户订单编号	C	10	
6	SDDH	交易所订单编号	C	16	
7	ZXBH	执行编号	C	16	
8	DDSY LX	订单所有者类型	N	4,0	
9	YWLS H	业务流水号	C	16	
10	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
11	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
12	JYDY	交易单元	C	6	
13	JSZH	结算账号	C	6	

14	BZZH	资金账户	C	25	
15	HBDH	货币代号	C	3	
16	HYBM	合约编码	C	8	
17	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格
18	MMFX	买卖方向	C	1	
19	KPBZ	开平仓标志	C	1	
20	BDBZ	备兑标志	C	1	
21	CJSL	成交数量	N	15,2	
22	QSSL	清算数量	N	15,2	
23	JSSL	交收数量	N	15,2	
24	BDSL	标的数量	N	15,2	
25	CJG	成交价格	N	13,4	
26	QSJG	清算价格	N	18,9	
27	BYJG	备用价格	N	18,9	
28	QSZJ	清算资金	N	17,2	正数表示参与人应收，负数表示参与人应付
29	JYJSF	交易经手费	N	17,2	
30	GHF	过户费	N	17,2	
31	JSF	结算费	N	17,2	
32	QTJE1	其他金额 1	N	17,2	
33	QTJE2	其他金额 2	N	17,2	
34	QTJE3	其他金额 3	N	17,2	
35	QTJE4	其他金额 4	N	17,2	
36	QTJE5	其他金额 5	N	17,2	
37	SFJE	收付净额	N	17,2	
38	JSBZ	交收标志	C	1	
39	CJRQ	成交日期	C	8	CCYYMMDD
40	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
41	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
42	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
43	ZYDH	摘要代号	C	3	
44	CJSJ	成交时间	C	9	HHMMSSsss
45	BYBZ	备用标志	C	1	
46	BYSL	备用数量	N	15,2	
47	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。

(2) SFJE 字段，一般情况下 $SFJE = QSZJ + JYJSF + GHF + JSF + QTJE1 + QTJE2 + QTJE3 + QTJE4 + QTJE5$ ，特殊情况参见具体业务定义。

(3) DDBH 字段对应深交所的客户订单编号；SDDH 对应深交所的交易所

订单编号；ZXBH 字段对应深交所的执行编号；DDSYLX 对应深交所的成交申报订单所有者类型；DDSYLX 字段对应深交所的订单所有者类型，取值范围请参考 SQ_GBXX.DBF 中 GBLB='DDLX'的数据定义。

(4) JSFS 字段的取值说明如下：‘Y’=净额担保交收。

(5) HBDH 字段的取值说明如下：‘RMB’=人民币。

(6) MMEFX 字段的取值说明如下：‘B’=买；‘S’=卖。

(7) KPBZ 字段的取值说明如下：‘O’=开仓；‘C’=平仓。

(8) BDBZ 字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

(9) ZYDH 字段，若数据类型 SJLX='04'且 ZYDH 字段不为空，则表示错误反馈，摘要代号定义请参考 SQ_GBXX.DBF 中 GBLB='ZYDH'的数据定义或参见附件一。

(10) SQ_JSMX.DBF 的数据填写说明如下：

A. 交易清算、交易经手费每日优惠明细

序号	字段名	字段描述	交易清算	交易经手费每日优惠明细
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘01’=衍生品清算数据	‘01’=衍生品清算数据
3	YWL B	业务类别	‘Q101’=期权交易	‘Q104’=交易经手费优惠（含返还和奖励）
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
5	DDBH	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
6	SDDH	交易所订单编号	交易所订单编号	交易所订单编号
7	ZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
8	DDSYLX	订单所有者类型	1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起 104=自营交易发起 105=流动性服务提供商发起 106=结算公司发起	空
9	YWL SH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	证券账号

11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码
12	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
15	HBDH	货币代号	‘RMB’	‘RMB’
16	HYBM	合约编码	合约编码	合约编码
17	BDDM	标的代码	标的证券代码	空
18	MMFX	买卖方向	‘B’=买 ‘S’=卖	‘B’=买 ‘S’=卖
19	KPBZ	开平仓标志	‘O’=开仓 ‘C’=平仓	‘O’=开仓 ‘C’=平仓
20	BDBZ	备兑标志	‘G’=普通仓 ‘C’=备兑仓	‘G’=普通仓 ‘C’=备兑仓
21	CJSL	成交数量	合约数量（单位：张，正数）	合约数量（单位：张，正数）
22	QSSL	清算数量	清算数量	合约数量（单位：张，正数）
23	JSSL	交收数量	交收数量	0
24	BDSL	标的数量	标的券数量（单位：股或份，买入方为 0，备兑开仓的卖出方表示需交付的证券数量）	0
25	CJG	成交价格	成交价格	成交价格
26	QSJG	清算价格	清算价格	清算价格
27	BYJG	备用价格	0	0
28	QSZJ	清算资金	权利金，正数表示应收，负数表示应付	交易经手费返还金额（正数）
29	JYJSF	交易经手费	交易经手费（负数）	0
30	GHF	过户费	0	0
31	JSF	结算费	结算费（负数）	0
32	QTJE1	其他金额 1	0	成交奖励金额（正数）
33	QTJE2	其他金额 2	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5

38	JSBZ	交收标志	'Y'	空
39	CJRQ	成交日期	成交日期	成交日期
40	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期
41	JSRQ	交收日期	交收日期	空
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期
43	ZYDH	摘要代号	空	空
44	CJSJ	成交时间	成交时间	成交时间
45	BYBZ	备用标志	空	主动成交：'0' 被动成交：'1' 主动成交为流动性消耗者；被动成交为流动性提供者。
46	BYSL	备用数量	0	0
47	BYZF	备用字符	空	记录序号

B. 备兑不足转普通仓、行权指派

序号	字段名	字段描述	备兑不足转普通仓	行权指派
1	SCDM	市场代码	'01'=深交所期权市场	'01'=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	'01'=衍生品清算数据	'01'=衍生品清算数据
3	YWL B	业务类别	'Q102'=备兑券不足转普通仓	'Q201'=期权行权 'Q215'=认沽期权 E 日转现金结算
4	JSFS	交收方式	'Y'=净额担保交收	'Y'=净额担保交收
5	DDBH	客户订单编号	空	空
6	SDDH	交易所订单编号	空	空
7	ZXBH	执行编号	空	空
8	DDSYLX	订单所有者类型	空	空
9	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	证券账号
11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码
12	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	空	衍生品保证金账户
15	HBDH	货币代号	'RMB'	'RMB'
16	HYBM	合约编码	合约编码	合约编码

17	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码
18	MMFX	买卖方向	‘S’=卖	‘B’=买 ‘S’=卖
19	KPBZ	开平仓标志	‘O’=开仓	空
20	BDBZ	备兑标志	‘C’=备兑仓	‘G’=普通仓 ‘C’=备兑仓
21	CJSL	成交数量	开仓时提交备兑仓的合约数量	行权指派合约数量（单位：张，负数）
22	QSSL	清算数量	合约数量	合约数量（单位：张，负数）
23	JSSL	交收数量	标的锁定成功的合约数量（QSSL-JSSL=转普通仓的数量）	0
24	BDSL	标的数量	锁定标的券数量	标的券收付数量（正数表示应收，负数表示应付）
25	CJG	成交价格	0	行权价格
26	QSG	清算价格	0	清算价格
27	BYG	备用价格	0	0
28	QSZJ	清算资金	0	行权资金，正数表示应收，负数表示应付
29	JYJSF	交易经手费	0	0
30	GHF	过户费	0	0
31	JSF	结算费	0	结算费（负数）
32	QTJE1	其他金额 1	0	0
33	QTJE2	其他金额 2	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资金+交易经手费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5
38	JSBZ	交收标志	‘Y’	空
39	CJRQ	成交日期	成交日期	行权申报日
40	QSRQ	清算日期	清算日期	行权清算日
41	JSRQ	交收日期	交收日期	行权交收日
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期
43	ZYDH	摘要代号	空	空
44	CJSJ	成交时间	空	空
45	BYBZ	备用标志	空	空
46	BYSL	备用数量	0	0

47	BYZF	备用字符	空	空
----	------	------	---	---

C. 行权申报失败、证券业务申报失败、行权指令合并申报处理结果

序号	字段名	字段描述	行权申报失败	证券业务申报失败	行权指令合并申报处理结果
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘04’=衍生品申报失败通知	‘04’=衍生品申报失败通知	‘05’=衍生品申报处理结果
3	YWLB	业务类别	‘Q201’=期权行权	‘Q206’=转处置券扣划 ‘Q207’=转处置券归还 ‘Q208’=待清偿扣划客户 ‘Q209’=待清偿扣划自营 ‘Q212’=垫券 ‘Q213’=还券	‘Q201’=期权行权
4	JSFS	交收方式	空	空	空
5	DDBH	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号	空
6	SDDH	交易所订单编号	交易所订单编号	交易所订单编号	空
7	ZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	空
8	DDSY LX	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	空
9	YWLS H	业务流水号	空	空	空
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	本方证券账号	证券账号
11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	空	合约账户标识码
12	JYDY	交易单元	交易单元	本方交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	空	空	空
15	HBDH	货币代号	空	空	空
16	HYBM	合约编码	合约编码或空，合并申报时空	空	合约编码
17	BDDM	标的代码	空	标的证券代码	空
18	MMFX	买卖方向	‘B’=买	空	‘B’=买

19	KPBZ	开平仓标志	空	空	空
20	BDBZ	备兑标志	空	空	空
21	CJSL	成交数量	申报数量	0	申报数量
22	QSSL	清算数量	0	0	有效数量
23	JSSL	交收数量	0	0	0
24	BDSL	标的数量	0	申报数量	0
25	CJG	成交价格	0	0	0
26	QSG	清算价格	0	0	0
27	BYG	备用价格	0	0	0
28	QSZJ	清算资金	0	0	0
29	JYJSF	交易经手费	0	0	0
30	GHF	过户费	0	0	0
31	JSF	结算费	0	0	0
32	QTJE1	其他金额 1	0	0	0
33	QTJE2	其他金额 2	0	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	0
38	JSBZ	交收标志	空	空	空
39	CJRQ	成交日期	申报日期	申报日期	申报日期
40	QSRQ	清算日期			
41	JSRQ	交收日期			
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
43	ZYDH	摘要代号	摘要代号	摘要代号	空
44	CJSJ	成交时间	空	空	空
45	BYBZ	备用标志	空	空	空
46	BYSL	备用数量	0	0	0
47	BYZF	备用字符	空	扩展交易单元	空

				+‘ ’+扩展证券账户	
--	--	--	--	-------------	--

2. 衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF

文件内容:

投资者期权合约的持仓数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位, 左对齐, 余位补空格
3	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	HYBM	合约编码	C	8	
7	CCFX	持仓方向	C	1	
8	BDBZ	备兑标志	C	1	
9	CCSL	持仓数量	N	15,2	
10	WCBZJ	维持保证金	N	17,2	
11	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
12	BYSL	备用数量	N	15,2	参与组合的期权合约持仓数量
13	BYJE	备用金额	N	17,2	
14	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。

(2) CCFX 字段的取值说明如下: ‘L’=权利方; ‘S’=义务方。

(3) BDBZ 字段的取值说明如下: ‘G’=普通仓; ‘C’=备兑仓。

3. 衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF

文件内容:

投资者期权合约的当天持仓变动数据, 按变动类型汇总。相关的标的证券变动数据通过现货系统的 SJSJG 文件发送。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位, 左对齐, 余位补空格
3	ZHBS	合约账户	C	6	结算账号

		标识码			
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	HYBM	合约编码	C	8	
7	BDSL	变动数量	N	15,2	
8	CCFX	持仓方向	C	1	
9	BDBZ	备兑标志	C	1	
10	BDLX	变动类型	C	3	‘C01’=期权开仓 ‘C02’=期权平昨仓 ‘C03’=期权平今仓 ‘C04’=期权未参与行权注销 ‘C05’=期权行权后注销 ‘C06’=备兑标的不足调整 ‘C07’=净持仓处理 ‘C08’=移仓 ‘C09’=普通转备兑 ‘C10’=备兑转普通
11	SLLX	数量类型	C	1	预留
12	BDRQ	变动日期	C	8	CCYYMMDD
13	BYSL	备用数量	N	15,2	
14	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。

(2) CCFX 字段的取值说明如下：‘L’=权利方；‘S’=义务方。

(3) BDBZ 字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

4. 衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF

文件内容：

日终衍生品保证金账户状态以及账户相关资金数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	启用 10 位，左对齐，余位补空格
2	JSZH	结算账号	C	6	
3	ZJXXLB	资金信息类别	C	2	‘00’=账户余额 ‘01’=次一交易日可用余额 ‘02’=应交维持保证金 ‘04’=最低结算准备金
4	ZJJE	资金金额	N	17,2	正数表示收入，负数表示支出

5	HBDH	货币代号	C	3	
6	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
7	BYZF	备用字符	C	40	

- (1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。
- (2) 一个衍生品保证金账户会有多条记录,相同的资金信息类别只有一条记录。
- (3) 金额字段是带符号的:资金信息类别‘02’/‘04’都>0,表示锁定的资金。
- (4) 资金信息类别‘02’是应锁定的资金金额,并不是已经锁定的资金。

5. 衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF

文件内容:

当日资金变动数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZJZH	资金账户	C	25	衍生品保证金账户
2	JSZH	结算账号	C	6	
3	HBDH	货币代号	C	3	
4	YWL	业务类别	C	4	‘Q001’=出入金 ‘Q002’=调账 ‘Q003’=结息 ‘Q005’=违约金收取 ‘Q007’=柜台提款 ‘Q010’=直接扣款 ‘Q020’=预约提款 ‘Q101’=期权交易 ‘Q201’=期权行权 ‘Q202’=行权证券违约转现金结算 ‘Q203’=行权资金违约(价差保证金划至待清偿账户) ‘Q211’=待清偿资金返还 ‘Q215’=认沽期权E日转现金结算 ‘ZJ11’=客户到自营佣金划转 ‘ZJ16’=客户到自营其他资金划转 ‘ZJ20’=自营到客户划转
5	ZJLSH	资金流水号	C	16	
6	SFJE	收付净额	N	17,2	
7	QSZJ	清算资金	N	17,2	正数表示应收,负数表示应付
8	JYJSF	交易经手费	N	17,2	

9	GHF	过户费	N	17,2	
10	JSF	结算费	N	17,2	
11	QTJE1	其他金额 1	N	17,2	
12	QTJE2	其他金额 2	N	17,2	
13	QTJE3	其他金额 3	N	17,2	
14	QTJE4	其他金额 4	N	17,2	
15	QTJE5	其他金额 5	N	17,2	
16	TGDY	托管单元	C	6	备用
17	CPLB	产品类别	C	2	
18	DFZH	资金账户 2	C	25	
19	JZRQ	记账日期	C	8	CCYYMMDD
20	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
21	BZXX	备注信息	C	20	
22	BYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明信息：

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人，用于资金账户变更的事后对账。

(2) 业务类别表示每笔资金变动的含义。

(3) 交收数据的每笔记账，是“业务类别”粒度，包含本金和税费。

(4) 金额字段都是带符号的。季度结息数据（业务类别=‘Q003’）在每季度结息日（如遇节假日，则为节假日的前一工作日）才有数据内容，其他日期无该业务数据。结息时结息账户填在资金账户 2 的 DFZH 字段，该字段暂时只用于该业务。

(5) 期权行权‘Q201’的数据会有两笔，一笔是行权净应收应付数据，一笔是行权证券过户的过户费数据。

6. 资金净额交收库 SQ_ZJJE.DBF

文件内容：

1. 资金交收清算汇总数据和交收结果，汇总到衍生品保证金账户或交易单元级别，按结算账号和交收日期汇总。
2. 违约金清算数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	‘02’=衍生品业务清算汇总

					‘03’=衍生品业务交收结果
3	YWLB	业务类别	C	4	‘Q201’=期权行权 ‘Q215’=认沽期权 E 日转现金结算 ‘Q005’=违约金清算
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	YWLSH	业务流水号	C	16	
6	JYDY	交易单元	C	6	
7	JSZH	结算账号	C	6	
8	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
9	HBDH	货币代号	C	3	
10	ZJJE	资金金额	N	17,2	
11	JSF	结算费	N	17,2	
12	QTJE	其他金额	N	17,2	备用
13	SFJE	收付净额	N	17,2	
14	WYJE	违约金	N	17,2	
15	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
16	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
17	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
18	BYSL	备用数量	N	15,2	
19	BYZF	备用字符	C	40	

说明信息：

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人，用于资金交收的通知和对账。

(2) 数据类型为‘02’时，收付净额=资金金额+结算费+其他金额。

(3) JSFS 字段的取值说明如下：‘Y’=净额担保交收。

(4) SQ_ZJJE.DBF 的数据说明如下：

A. 期权行权资金净额交收通知

序号	字段名	字段描述	期权行权资金净额交收通知（衍生品保证金账户汇总）	期权行权资金净额交收通知（交易单元汇总）
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘02’=衍生品业务清算汇总	‘02’=衍生品业务清算汇总
3	YWLB	业务类别	‘Q201’=期权行权 ‘Q215’=认沽期权 E 日转现金结算	‘Q201’=期权行权 ‘Q215’=认沽期权 E 日转现金结算
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
5	YWLSH	业务流水	业务流水号	业务流水号

		号		
6	JYDY	交易单元	空	交易单元
7	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
8	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
9	HBDH	货币代号	‘RMB’	‘RMB’
10	ZJJE	资金金额	行权交收净应收付金额	行权交收净应收付金额
11	JSF	结算费	结算费（负数）	结算费（负数）
12	QTJE	其他金额	0	0
13	SFJE	收付净额	收付净额=资金金额+结算费+其他金额	收付净额=资金金额+结算费+其他金额
14	WYJE	违约金额	0	0
15	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期
16	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期
17	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期
18	BYSL	备用数量	0	0
19	BYZF	备用字符	空	空

B. 期权行权资金净额交收结果、违约金清算

序号	字段名	字段描述	期权行权资金净额交收结果	违约金清算
20	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
21	SJLX	数据类型	‘03’=衍生品业务交收结果	‘02’=衍生品业务清算汇总
22	YWLB	业务类别	‘Q201’=期权行权 ‘Q215’=认沽期权 E 日转 现金结算	‘Q005’=违约金清算
23	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
24	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
25	JYDY	交易单元	空	空
26	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
27	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
28	HBDH	货币代号	‘RMB’	‘RMB’
29	ZJJE	资金金额	行权交收原净应收付金额	违约金（负数）
30	JSF	结算费	结算费（负数）	0
31	QTJE	其他金额	0	0
32	SFJE	收付净额	行权交收实际收付金额	收付净额=资金金额+结算费+其他金额
33	WYJE	违约金额	违约金额	违约本金（正数）
34	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期

35	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期
36	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期
37	BYSL	备用数量	0	0
38	BYZF	备用字符	空	违约日期

7. 证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF

文件内容：

1. 证券交收的清算汇总和交收结果，按标的证券汇总到投资者级别。
2. 转处置券、待清偿券、垫券交收业务的成功处理结果。

具体数据包括：

1. 期权行权证券净额清算汇总和交收成功结果，包括行权标的过户费。
2. 行权交收失败违约应收券的锁定通知、行权证券交收失败转现金结算。
3. 备兑券的锁定数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	‘02’=衍生品业务清算汇总 ‘03’=衍生品业务交收结果
3	YWLB	业务类别	C	4	‘Q103’=备兑券锁定 ‘Q201’=期权行权 ‘Q202’=行权证券违约转现金结算 ‘Q203’=行权资金违约待清偿扣划 ‘Q206’=转处置券扣划 ‘Q207’=转处置券归还 ‘Q208’=申报待清偿扣划客户 ‘Q209’=申报待清偿扣划自营 ‘Q210’=待清偿证券返还 ‘Q212’=垫券 ‘Q213’=还券
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	YWLSH	业务流水号	C	16	
6	JYDY	交易单元	C	6	
7	JSZH	结算账号	C	6	
8	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
9	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
10	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格
11	QSSL	清算数量	N	15,2	
12	JSSL	交收数量	N	15,2	

13	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
14	HBDH	货币代号	C	3	
15	ZJJE	资金金额	N	17,2	
16	GHF	过户费	N	17,2	
17	QTJE	其他金额	N	17,2	
18	SFJE	收付净额	N	17,2	
19	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
20	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
21	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
22	BYSL	备用数量	N	15,2	
23	BYZF	备用字符	C	40	

说明信息：

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人，用于证券交收的通知和对账。

(2) 若行权证券交收部分成功，剩余部分转现金结算，则 E 日的一笔交收通知（SJLX='02'）对应行权交收日的业务类别为‘Q201’和‘Q202’的交收结果（SJLX='03'）各一笔。

(3) 收付净额=资金金额+过户费+其他金额。

(4) 业务类别‘Q206’、‘Q207’对应深交所申报的转处置扣券、还券业务；业务类别‘Q208’、‘Q209’对应深交所申报的待清偿扣划客户申报、待清偿扣划自营申报；业务类别‘Q212’、‘Q213’对应深交所申报的垫券、还券业务。

(5) 参与人行权资金违约，先按申报扣划客户或自营净应收券，体现于业务类别‘Q208’、‘Q209’，若申报处理后未能覆盖交收违约金额，则按结算公司的约定算法自行扣划证券，体现于业务类别‘Q203’。

(6) JSFS 字段的取值说明如下：‘Y’=净额担保交收。

(7) SQ_ZQJE.DBF 的数据说明如下：

A. 期权行权证券净额汇总、期权行权证券净额交收成功结果、期权行权证券不足转现金结算

序号	字段名	字段描述	期权行权证券净额汇总	期权行权证券净额交收成功结果	期权行权证券不足转现金结算
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘02’=衍生品业	‘03’=衍生品业务	‘03’=衍生品业

			务清算汇总	交收结果	务交收结果
3	YWL B	业务类别	‘Q201’= 期 权 行权	‘Q201’=期权行权	‘Q202’=行权证 券违约转现金结 算
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净 额 担 保 交收	‘Y’=净 额 担 保 交 收	‘Y’=净 额 担 保 交 收
5	YWLSH	业务流水 号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
7	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8	ZQZH	证券账户 号码	证券账号	证券账号	证券账号
9	ZHBS	合约账户 标识码	结算账号	结算账号	结算账号
10	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
11	QSSL	清算数量	行权应收应付 证券数量	行权应收应付证 券数量	行权应收应付证 券数量
12	JSSL	交收数量	0	实际交收的证券 数量	转现金结算的证 券股数
13	BZZH	衍生品保 证金账户	空	空	衍生品保证金账 户
14	HBDH	货币代号	空	空	‘RMB’
15	ZJJE	资金金额	0	0	转现金结算的金 额
16	GHF	过户费	过户费	过户费	0
17	QTJE	其他金额	0	0	0
18	SFJE	收付净额	收 付 净 额 = 资 金 金 额 + 过 户 费 + 其他金额	收 付 净 额 = 资 金 金 额 + 过 户 费 + 其 他 金 额	收 付 净 额 = 资 金 金 额 + 过 户 费 + 其 他 金 额
19	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22	BYSL	备用数量	0	0	0
23	BYZF	备用字符	空	空	空

B. 期权行权交收失败违约应收券锁定通知、期权行权申报转处置券扣券还券、备兑证券的锁定情况

序号	字段名	字段描述	期权行权交收 失败违约应收 券锁定通知(转 处置)	期权行权申报转 处置券扣券还券	备兑证券的锁定 情况
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期	‘01’=深交所期权	‘01’=深交所期权

			权市场	市场	市场
2	SJLX	数据类型	‘03’=衍生品业务交收结果	‘03’=衍生品业务交收结果	‘03’=衍生品业务交收结果
3	YWL B	业务类别	‘Q203’=行权资金违约(违约应收券锁定)	‘Q206’=转处置券扣划 ‘Q207’=转处置券归还	‘Q103’=备兑券锁定
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
5	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6	JYDY	交易单元	交易单元	申报的本方交易单元	交易单元
7	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8	ZQZH	证券账户号码	证券账号	申报的本方证券账号	证券账号
9	ZHBS	合约账户标识码	空	空	结算账号
10	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
11	QSSL	清算数量	行权应收应付证券数量	0	应锁定证券数量(正数)
12	JSSL	交收数量	待处置的证券数量	扣划或返还的证券数量(负数)	实际锁定证券数量(正数)
13	BZZH	衍生品保证金账户	空	空	空
14	HBDH	货币代号	空	空	空
15	ZJJE	资金金额	0	0	0
16	GHF	过户费	0	0	0
17	QTJE	其他金额	0	0	0
18	SFJE	收付净额	收付净额=资金金额+过户费+其他金额	收付净额=资金金额+过户费+其他金额	收付净额=资金金额+过户费+其他金额
19	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22	BYSL	备用数量	0	0	0
23	BYZF	备用字符	空	交易单元+‘ ’+处置扣券或返回的对手方账户	空

C. 期权行权申报待清偿扣划证券、待清偿证券返还、垫券交收

序号	字段名	字段描述	期权行权申报 待清偿扣划证 券	待清偿证券返还	垫券交收
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期 权市场	‘01’=深交所期 权市场	‘01’=深交所期 权市场
2	SJLX	数据类型	‘03’=衍生品业 务交收结果	‘03’=衍生品业 务交收结果	‘03’=衍生品业 务交收结果
3	YWL B	业务类别	‘Q208’=待清偿 扣划客户 ‘Q209’=待清偿 扣划自营	‘Q210’=待清偿证 券返还	‘Q212’=垫券 ‘Q213’=还券
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净 额 担 保 交收	‘Y’=净 额 担 保 交 收	‘Y’=净 额 担 保 交 收
5	YWLSH	业务流水 号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6	JYDY	交易单元	申报的本方交 易单元	交易单元	申报的本方交易 单元
7	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8	ZQZH	证券账户 号码	申报的本方证 券账号	证券账号	申报的本方证券 账号
9	ZHBS	合约账户 标识码	空	空	空
10	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
11	QSSL	清算数量	申报证券数量 (正数)	0	申报证券数量 (正数)
12	JSSL	交收数量	实际处理证券 数量 (正数)	返还的证券数量 (正数)	实际处理证券数 量 (正数)
13	BZZH	衍生品保 证金账户	空	空	空
14	HBDH	货币代号	空	空	空
15	ZJJE	资金金额	0	0	0
16	GHF	过户费	0	0	0
17	QTJE	其他金额	0	0	0
18	SFJE	收付净额	收付净额=资金 金 额+过 户 费+ 其他金额	收付净额=资金 金 额+过 户 费+其 他 金 额	收付净额=资金 金 额+过 户 费+其 他 金 额
19	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22	BYSL	备用数量	0	0	0
23	BYZF	备用字符	交易单元+‘ ’+ 空	空	交易单元+‘ ’+借

			扣券证券账户		券或还券的对手方证券账户
--	--	--	--------	--	--------------

8. 组合持仓明细库 SQ_ZHCC.DBF

文件内容：

投资者期权组合持仓的明细数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
3	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	ZHBH	组合编号	C	16	
7	ZHCLB M	组合策略编码	C	8	
8	ZHFS	组合份数	N	15, 2	
9	DWBZJ	单位保证金	N	15, 2	
10	CFHYS	组合策略的成分合约数	N	2, 0	
11	HYBM1	第一个成分合约的合约编码	C	8	
12	CCFX1	第一个成分合约的持仓方向	C	1	
13	BDBZ1	第一个成分合约的备兑标志	C	1	
14	HYBM2	第二个成分合约的合约编码	C	8	
15	CCFX2	第二个成分合约的持仓方向	C	1	
16	BDBZ2	第二个成分合约的备兑标志	C	1	
17	HYBM3	第三个成分合约的合约编码	C	8	
18	CCFX3	第三个成分合约的持仓方向	C	1	
19	BDBZ3	第三个成分合约的备兑标志	C	1	
20	HYBM4	第四个成分合	C	8	

		约的合约编码			
21	CCFX4	第四个成分合约的持仓方向	C	1	
22	BDBZ4	第四个成分合约的备兑标志	C	1	
23	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
24	BYSL	备用数量	N	15,2	
25	BYJE	备用金额	N	17,2	
26	BYZF	备用字符	C	40	

- (1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。
- (2) 本库数据与交易明细保持一致，非汇总合并数据。
- (3) CCFX*字段的取值说明如下：‘L’=权利方；‘S’=义务方。
- (4) BDBZ*字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

9. 保证金明细库 SQ_BZJMX.DBF

文件内容：
投资者的保证金明细数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
3	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	BZJLX	保证金类型	C	3	‘001’=单笔保证金 ‘002’=组合保证金
7	ZJLX	资金类型	C	3	‘001’=应交维持保证金
8	HYBM	合约编码	C	8	
9	CCFX	持仓方向	C	1	
10	BDBZ	备兑标志	C	1	
11	ZHBH	组合编号	C	16	
12	ZHCLBM	组合策略编码	C	8	
13	CCSL	持仓数量	N	15,2	
14	DWBZJ	单位保证金	N	15,2	
15	WCBZJ	维持保证金	N	17,2	维持保证金=持仓数量*单位保证金

16	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
17	SL1	数量 1	N	15,2	
18	SL2	数量 2	N	15,2	
19	JE1	金额 1	N	17,2	
20	JE2	金额 2	N	17,2	
21	BL1	比率 1	N	20,4	
22	BL2	比率 2	N	20,4	
23	BH1	编号 1	C	16	
24	BH2	编号 2	C	16	
25	BYZF	备用字符	C	40	

- (1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。
- (2) BZJLX 字段的取值说明如下:‘001’=单笔保证金;‘002’=组合保证金。
- (3) ZJLX 字段的取值说明如下:‘001’=应交维持保证金。
- (4) SQ_BZJMX.DBF 的数据说明如下:

序号	字段名	字段描述	单笔保证金	组合保证金
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码
3	ZHBS	合约账户标识码	结算账号	结算账号
4	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元
5	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
6	BZJLX	保证金类型	‘001’=单笔保证金	‘002’=组合保证金
7	ZJLX	资金类型	‘001’=应交维持保证金	‘001’=应交维持保证金
8	HYBM	合约编码	合约编码	空
9	CCFX	持仓方向	‘L’=权利方 ‘S’=义务方	空
10	BDBZ	备兑标志	‘G’=普通仓 ‘C’=备兑仓	空
11	ZHBH	组合编号	空	组合编号
12	ZHCLB M	组合策略编码	空	组合策略编码
13	CCSL	持仓数量	持仓数量	组合份数
14	DWBZJ	单位保证金	单位保证金	组合单位保证金
15	WCBZJ	维持保证金	维持保证金=持仓数量*单位保证金	维持保证金=组合份数*组合单位保证金
16	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期

17	SL1	数量 1	0	0
18	SL2	数量 2	0	0
19	JE1	金额 1	0	0
20	JE2	金额 2	0	0
21	BL1	比率 1	0	0
22	BL2	比率 2	0	0
23	BH1	编号 1	空	空
24	BH2	编号 2	空	空
25	BYZF	备用字符	空	空

10.参考信息库 SQ_CKXX.DBF

文件内容：

投资者期权组合策略构建解除、转仓明细数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	‘06’=期权组合策略构建解除及转仓数据
3	YWL B	业务类别	C	4	‘Q107’=构建组合 ‘Q108’=解除组合（含强制解除） ‘Q109’=到期自动解除 ‘Q105’=转备兑 ‘Q106’=转普通
4	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
5	ZHBS	合约账户标识 码	C	6	
6	CJSJ	成交时间	C	9	空或 HHMMSSsss
7	DDBH	客户订单编号	C	10	
8	SDDH	交易所订单编 号	C	16	
9	ZXBH	执行编号	C	16	
10	DEDDBH	第二交易所订 单编号	C	16	
11	DDSYLX	订单所有者类 型	N	4,0	
12	JYDY	交易单元	C	6	
13	JSZH	结算账号	C	6	
14	ZHCLBM	组合策略编码	C	8	
15	ZHFS	组合份数	N	15,2	
16	CFHYS	组合策略的成	N	2,0	

		分合约数			
17	HYBM1	第一个成分合约的合约编码	C	8	
18	CCFX1	第一个成分合约的持仓方向	C	1	
19	BDBZ1	第一个成分合约的备兑标志	C	1	
20	CFSL1	第一个成分合约数量	N	15,2	
21	HYBM2	第二个成分合约的合约编码	C	8	
22	CCFX2	第二个成分合约的持仓方向	C	1	
23	BDBZ2	第二个成分合约的备兑标志	C	1	
24	CFSL2	第二个成分合约数量	N	15,2	
25	HYBM3	第三个成分合约的合约编码	C	8	
26	CCFX3	第三个成分合约的持仓方向	C	1	
27	BDBZ3	第三个成分合约的备兑标志	C	1	
28	CFSL3	第三个成分合约数量	N	15,2	
29	HYBM4	第四个成分合约的合约编码	C	8	
30	CCFX4	第四个成分合约的持仓方向	C	1	
31	BDBZ4	第四个成分合约的备兑标志	C	1	
32	CFSL4	第四个成分合约数量	N	15,2	
33	ZQDM	证券代码	C	8	
34	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
35	HBDH	货币代号	C	3	
36	JE1	金额 1	N	17,2	
37	JE2	金额 2	N	17,2	
38	SL1	数量 1	N	15,2	
39	SL2	数量 2	N	15,2	

40	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
41	ZF	字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。

(2) CCFX*字段的取值说明如下：‘L’=权利方；‘S’=义务方。

(3) BDBZ*字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

(4) YWLB 业务类别字段取值为‘Q108’，且订单所有者为 101 或 106 的，

表示为交易所强制解除。

具体填写数据说明：

序号	字段名	字段描述	构建组合、解除组合（含强制解除）	到期自动解除	转备兑、转普通
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘06’=期权组合策略构建解除及转仓数据	‘06’=期权组合策略构建解除及转仓数据	‘06’=期权组合策略构建解除及转仓数据
3	YWLB	业务类别	‘Q107’=构建组合 ‘Q108’=解除组合（含强制解除）	‘Q109’=到期自动解除	‘Q105’=转备兑 ‘Q106’=转普通
4	ZQZH	证券账户号码	启用 10 位，左对齐，余位补空格	启用 10 位，左对齐，余位补空格	启用 10 位，左对齐，余位补空格
5	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码
6	CJSJ	成交时间	成交时间	空	成交时间
7	DDBH	客户订单编号	客户订单编号	空	客户订单编号
8	SDDH	交易所订单编号	交易所订单编号	组合编号，即组合构建时的交易所订单编号	交易所订单编号
9	ZXBH	执行编号	执行编号	空	执行编号
10	DEDDBH	第二交易所订单编号	构建组合时填空格，解除组合时填拟解除组合对应的组合编号	空	空
11	DDSYLX	订单所有者类型	1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起	106=结算公司发起	1=个人投资者发起 101=交易所发起 102=会员发起 103=机构投资者发起

			104= 自营交易发起 105= 流动性服务提供商发起 106= 结算公司发起		104= 自营交易发起 105= 流动性服务提供商发起 106= 结算公司发起
12	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	空	空	空
14	ZHCLBM	组合策略编码	目前为 6 种组合策略：CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS	目前为 6 种组合策略：CNSJC、PXSJC、PNSJC、CXSJC、KS、KKS	空
15	ZHFS	组合份数	组合份数	组合份数	转仓数量
16	CFHYS	组合策略的成分合约数	组合策略的成分合约数	组合策略的成分合约数	0
17	HYBM1	第一个成分合约的合约编码	第一个成分合约的合约编码	第一个成分合约的合约编码	合约编码
18	CCFX1	第一个成分合约的持仓方向	第一个成分合约的持仓方向	第一个成分合约的持仓方向	空
19	BDBZ1	第一个成分合约的备兑标志	第一个成分合约的备兑标志	第一个成分合约的备兑标志	空
20	CFSL1	第一个成分合约数量	第一个成分合约数量	第一个成分合约数量	0
21	HYBM2	第二个成分合约的合约编码	第二个成分合约的合约编码	第二个成分合约的合约编码	空
22	CCFX2	第二个成分合约的持仓方向	第二个成分合约的持仓方向	第二个成分合约的持仓方向	空
23	BDBZ2	第二个成分合约的备兑标志	第二个成分合约的备兑标志	第二个成分合约的备兑标志	空
24	CFSL2	第二个成分合约数量	第二个成分合约数量	第二个成分合约数量	0
25	HYBM3	第三个成分合约的	第三个成分合约的合约编码	第三个成分合约的合约编码	空

		合约编码			
26	CCFX3	第三个成分合约的持仓方向	第三个成分合约的持仓方向	第三个成分合约的持仓方向	空
27	BDBZ3	第三个成分合约的备兑标志	第三个成分合约的备兑标志	第三个成分合约的备兑标志	空
28	CFSL3	第三个成分合约数量	第三个成分合约数量	第三个成分合约数量	0
29	HYBM4	第四个成分合约的合约编码	第四个成分合约的合约编码	第四个成分合约的合约编码	空
30	CCFX4	第四个成分合约的持仓方向	第四个成分合约的持仓方向	第四个成分合约的持仓方向	空
31	BDBZ4	第四个成分合约的备兑标志	第四个成分合约的备兑标志	第四个成分合约的备兑标志	空
32	CFSL4	第四个成分合约数量	第四个成分合约数量	第四个成分合约数量	0
33	ZQDM	证券代码	空	空	空
34	BZZH	衍生品保证金账户	空	空	空
35	HBDH	货币代号	空	空	空
36	JE1	金额 1	0	0	0
37	JE2	金额 2	0	0	0
38	SL1	数量 1	0	0	0
39	SL2	数量 2	0	0	0
40	FSRQ	发送日期	CCYYMMDD	CCYYMMDD	CCYYMMDD
41	ZF	字符	空	空	空

11.通知文件 SQ_TZWJ.DBF

文件内容：

1. 强平通知。
2. 合约调整导致锁定证券不足差额数据。

保证金不足通知有两种：

1. 衍生品保证金账户余额不足交收，即履约保证金不足，若不补足则次日强行平仓。

2. 衍生品保证金账户余额足够交收，但结算准备金余额不足，即剩余资金不足最低结算准备金，若不补足则不允许开新仓。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	‘03’=衍生品业务交收结果
3	TZLX	通知类型	C	4	‘T001’=强平通知 ‘T002’=结算准备金余额不足 ‘T101’=备兑证券锁定不足差额
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	TGDY	托管单元	C	6	
6	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
7	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
8	HYBM	合约编码	C	8	
9	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格
10	JSZH	结算账号	C	6	
11	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
12	HBDH	货币代号	C	3	
13	JE1	金额 1	N	17,2	
14	JE2	金额 2	N	17,2	
15	SL1	数量 1	N	15,2	
16	SL2	数量 2	N	15,2	
17	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
18	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日发送，若文件为空，则无通知数据。通知类型为‘T001’和‘T002’的数据是在结算参与人资金不足时发送的。

(2) 通知类型为‘T101’的数据是在锁定的担保证券不足时发送的，一般在发生合约调整时会有数据。若有数据，该数据会在合约调整生效日前一日发送。

(3) SQ_TZWJ.DBF 的数据说明如下：

序号	字段名	字段描述	强平通知	结算准备金余额不足	锁定担保证券不足
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘03’=衍生品业务交收结果	‘03’=衍生品业务交收结果	‘03’=衍生品业务交收结果
3	TZLX	通知类型	‘T001’=强平通知	‘T002’=结算准备金余额不足	‘T101’=备兑证券锁定不足差额

4	JYDY	交易单元	空	空	交易单元
5	TGDY	托管单元	空	空	托管单元
6	ZQZH	证券账户 号码	空	空	证券账户号码
7	ZHBS	合约账户 标识码	空	空	合约账户标识码
8	HYBM	合约编码	空	空	空
9	BDDM	标的代码	空	空	标的代码
10	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
11	BZZH	衍生品保 证金账户	衍生品保证 金账户	衍生品保证 金账户	空
12	HBDH	货币代号	RMB	RMB	空
13	JE1	金额 1	不足金额（负 数）。补足该部 分资金才不会 被强平（可用余 额小于 0）。	0	0
14	JE2	金额 2	0	不足金额（负 数）。补足该部 分资金才可以开 仓（小于最低结 算准备金）。	0
15	SL1	数量 1	0	0	锁定标的证券不 足数据（正数）
16	SL2	数量 2	0	0	0
17	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
18	BYZF	备用字符	空	空	空

12.广播信息 SQ_GBXX.DBF

文件内容：

广播信息，供参考。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	GBLB	广播类别	C	4	
3	DM1	代码 1	C	10	
4	DM2	代码 2	C	20	
5	SL	数量	N	17,2	
6	RQ1	日期 1	C	8	CCYYMMDD
7	RQ2	日期 2	C	8	CCYYMMDD
8	BL	比例	N	19,13	

9	JE1	金额 1	N	18,3	
10	JE2	金额 2	N	18,3	
11	BZSM	备注说明	C	100	
12	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD

本库由中国结算深圳分公司每日发送给所有参与人。

附件一 摘要代号汇编

摘要代号	说明
Q01	申报的合约无效
Q02	投资者无持仓
Q03	可申报数量不足
Q04	处置证券账户无效
Q05	自营证券账户未报备
Q06	无对应扣券记录
Q07	投资者非应收券方
Q08	投资者非应付券方
Q09	非经纪业务交易单元申报
Q10	非行权交收日申报 ETF 垫券
Q11	投资者无对应行权数据
Q12	证券代码无效
Q13	认沽合约标的证券不足
Q14	标的停牌且认沽合约非实值
Q15	当日有待清偿业务不处理转处置申报
Q16	现货交易单元无效
Q17	证券划出交易单元与证券划入交易单元非属同一参与人