

股票期权试点 结算数据接口规范 (结算参与人版 V1.05)



二零一九年八月

版本修订历史

更新日期	最新版本	修订说明
2019/8/7	1.05	配合期权行权指令合并申报, 修改 op-ywhb 数据填写说明。
2016/11/6	1.04	配合组合策略业务: 1. 修改“期权合约持仓变动数据文件”(op-ccbd)及“期权合约持仓数据文件”(op-hycc)的相关填写说明。 2. 新增“期权组合持仓明细数据文件(op-zhcc)”和“期权保证金明细数据文件(op-bzjmx)”。文件具体启用日期视业务通知。
2014/12/08	1.03	1. 停用衍生品合约账户开通/注销申报的PROP实时接口, 删除 op-zhqt (期权合约账户全体数据文件)和op-chbd (衍生品合约账户变动数据文件), 相关数据参见《账户系统数据接口规范(供开户代理机构使用)》的说明。 3. 删除op-ywhb (衍生品业务回报文件)中期权合约账户开通注销回报数据的填写说明。 4. 增加op-bzjzh (衍生品保证金账户数据文件)中资金类型的填写说明。 5. 修改op-jsmx (期权结算明细文件)中“F01”和“F02”的填写说明。
2014/05/07	1.02	增加op-jsmx文件记录格式“F04”(期权行权过户费明细数据)的填写说明。
2014/2/24	1.01	1. 增加op-tzxx文件, 包含备兑不足平仓通知和保证金不足平仓通知等数据。 2. 启用op-zqjs文件记录格式: F15, 修改相应的数据意义为: 备兑期权标的证券锁定情况记录, 修改附加说明字段描述为备兑期权证券实际锁定情况。 3. 增加op-zhqt文件, 包含当日与该清算编号相关的所有有效的的期权合约账户数据。 4. 在op-jsmx文件的期权交易结算记录中明确交易收费字段和备用字段的填写说明, 删除期权开户费用的填写说明。 5. 增加fsbz-op文件, 表示期权业务数据文件已全部发送完毕。
2013/12/04	1.0	修订了文档格式及规范
2013/12/03	0.95	备兑标志的取值含义改为: (‘1’: Covered 备兑; ‘’: Uncovered 非备兑)。 op-jsmx文件中增加开户费用。 op-jsmx文件中“F02”记录中的被行权合约填写备兑标志。 op-zqjs中增加行权申报扣券及返还的记录。 现货zqbd文件中, 增加期权行权申报处置证券及返还的过户类型。

2013/11/14	0.94	增加冻结原因“V”，表示认沽期权行权有效申报方锁券； op-zqjs（证券交收）文件接口的“备兑期权标的证券锁定净额汇总”F15记录改为预留，暂未实现。 增加“结果代码”数据字典
2013/11/12	0.93	1、增加了现货部分的接口，包括备兑锁券、认沽期权行权申报锁券、行权交收现券过户。 2、将op-jsmx文件行权清算明细（F02格式）中的备兑标志改为填“空”。
2013/10/15	0.92	1、将现金结算汇总交收结果（原F22记录格式）并入资金净额交收结果（F21记录格式）中。 2、合约持仓变动数据中，业务类型改为过户类型。 3、结算明细中补充了清算标志字段。 4、保证金账户数据中，002的取值含义由“已交维持保证金”更正为“应交维持保证金”。 5、修正了证券和资金的交收结果代码。 6、合约持仓变动文件中，字段TGDY和ZZHBM的位置互换一下。 7、修正了流通类型、权益类型等几个字段的长度位数。
2013/9/12	0.91	1、持仓改用8位合约产品代码。 2、行权清算方面增加了证券汇总交收通知和资金汇总交收通知。 3、增加了行权交收内容，包括交收结果、现金交割、欠款扣券。
2013/8/19	0.9	根据个股期权最新业务方案调整

目录

前言	5
1. 数据文件命名规则	5
2. 基本数据说明	5
发送数据文件接口规范	6
一. 数据接口文件清单	6
(一) 期权业务文件	6
(二) 现货文件	6
(三) 其他文件	6
二. 数据明细说明	7
(一) 中国结算上海分公司向结算参与人发送的期权文件	7
1、fsbz-op(期权数据文件发送结束标志文件)	7
2、op-bzjmx(期权保证金明细数据文件)	7
3、op-bzjzh(衍生品保证金账户数据文件)	9
4、op-ccbd(期权合约持仓变动数据文件)	9
5、op-hycc(期权合约持仓数据文件)	10
6、op-jsmx(期权结算明细文件)	11
7、op-tzxx(衍生品通知信息文件)	14
8、op-ywhb(衍生品业务回报文件)	16
9、op-zhcc(期权组合持仓明细数据文件)	18
10、op-zjjs(期权资金净额交收文件)	19
11、op-zqjs(期权证券净额交收文件)	21
(二) 中国结算上海分公司向结算参与人发送的现货文件	24
1、qtsl(证券其他数量对账文件)	24
2、tzxx(通知信息文件)	25
3、zqbd(证券变动文件)	25
4、zjbd(资金变动文件)	25
5、zjye(资金余额文件)	26
附录:	27

前言

1. 数据文件命名规则

目前我公司发送和接收的数据文件,均采用 FOXPRO2.5 下的标准 DBF 格式。为了减少数据通讯量,我公司发送的很多数据文件经过 ZIP 软件压缩后发送至 PROP 信箱中。

中国结算上海分公司发送给结算参与人的登记结算数据文件的命名规则为:

数据文件名 = “前缀” + “标识” + “.” + “后缀”;

前缀为文件代码,如 op-jsmx、op-zqjs 等;

标识 = 清算编号|其它|空;

后缀为数据日期,格式为 mdd 格式,其中 m 表示月,dd 表示日。当月份为 10、11、12 月时,m 的值分别为 ‘a’、‘b’、‘c’。

2. 基本数据说明

- 1、证券的数量单位为“股”、合约数量单位为“张”;金额单位为“元”。
- 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。

发送数据文件接口规范

一. 数据接口文件清单

(一) 期权业务文件

前缀	标识	说明
op-bzjzh	无	衍生品保证金账户数据文件
op-ccbd	清算编号	期权合约持仓变动数据文件
op-hycc	清算编号	期权合约持仓数据文件
op-jsmx	清算编号	期权结算明细文件
op-tzxx	无	衍生品通知信息文件
op-ywhb	无	衍生品业务回报文件
op-zjjs	无	期权资金净额交收数据文件
op-zqjs	清算编号	期权证券净额交收数据文件
op-zhcc	清算编号	期权组合持仓明细数据文件
op-bzjmx	无	期权保证金明细数据文件

(二) 现货文件

前缀	标识	说明
qtsl	清算编号	证券其他数量对账文件
tzxx	无	通知信息文件
zjbd	无	资金变动文件
zjye	无	资金余额文件
zqbd	清算编号	证券变动文件

(三) 其他文件

前缀	标识	说明
fsbz_op	空	期权数据文件发送结束标志文件

二. 数据明细说明

(一) 中国结算上海分公司向结算参与人发送的期权文件

1、fsbz-op(期权数据文件发送结束标志文件)

- 1) 文件名称: fsbz-op.mdd, mdd 为 3 位日期。
- 2) 数据内容: 空 (文件的字节数为 0)。
- 3) 文件生成单位: 结算参与人信箱。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 5) 发送时间: 每个交易日期权结算数据发送完成后。
- 6) 发送周期: 每个交易日。
- 7) 接口状态: 已启用
- 8) 数据格式: 文本, 不压缩。
- 9) 附加说明:

在该标志文件生成后, 表示期权业务登记结算数据文件已经全部发送完毕。

2、op-bzjmx(期权保证金明细数据文件)

- 1) 文件名称: op-bzjmx.mdd
- 2) 数据内容: 包括期权保证金明细数据。
- 3) 文件生成单位: 结算参与人信箱。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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	说明
1	ZJZH	Character	25		资金账户
2	QSBH	Character	5		清算编号
3	ZQZH	Character	10		证券账号
4	ZZHBM	Character	3		期权子账户编码 (固定填 “888”)
5	TGDY	Character	5		交易单元
6	BZJLX	Character	3		保证金类型
7	JELX	Character	3		资金类型
8	HEYDM	Character	8		期权合约产品代码
9	CCFX	Character	1		持仓方向
10	BDBZ	Character	1		备兑期权标志
11	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量1
12	SL2	Character	16		数量2

13	BH1	Character	16		编号1
14	BH2	Character	16		编号2
15	BL1	Character	17		比率1
16	BL2	Character	17		比率2
17	JE1	Character	19	±999999999999999.99	金额1
18	JE2	Character	19	±999999999999999.99	金额2
19	JE3	Character	19		金额3
20	BY	Character	20		备用

9) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	普通持仓保证金明细数据	组合保证金明细数据
1	ZJZH	资金账户	资金账户	资金账户
2	QSBH	清算编号	清算编号	清算编号
3	ZQZH	证券账号	证券账号	证券账号
4	ZZHBM	期权子账户编码	888	888
5	TGDY	交易单元	#	#
6	BZJLX	保证金类型	SGL: 非组合保证金;	CMP: 组合保证金
7	JELX	资金类型	002: 应交维持保证金金额 003: 行权锁定保证金金额	002: 应交维持保证金金额
8	HEYDM	期权合约产品代码	期权合约产品代码	组合策略编码
9	CCFX	持仓方向	‘L’ 权利方持仓; ‘S’ 义务方持仓	#
10	BDBZ	备兑期权标志	‘1’: Covered 备兑; ‘ ’: Uncovered 非备兑	#
11	SL1	数量1	期权合约持仓数量	组合份数
12	SL2	数量2	#	#
13	BH1	编号1	#	组合编号
14	BH2	编号2	#	#
15	BL1	比率1	#	#
16	BL2	比率2	#	#
17	JE1	金额1	单位保证金	组合单位保证金
18	JE2	金额2	应收维持保证金金额=单位 保证金×期权合约持仓数量	应收维持保证金金额=单 位保证金×组合份数
19	JE3	金额3	#	#
20	BY	备用	#	#

3、op_bzjzh (衍生品保证金账户数据文件)

- 1) 文件名称: op_bzjzh.mdd
 2) 数据内容: 包括期权保证金账户相关金额数据。
 3) 文件生成单位: 结算参与人信箱。
 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
 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	ZJZH	Character	25		期权保证金账户
2	JELX	Character	3		资金类型: 000: 账户余额; 001: 保证金可用金额 (可用金额为负表示保证金不足); 002: 应交维持保证金金额; 003: 行权锁定保证金金额; 004: 最低结算准备金; 005: 备用金额
3	JE	Character	19	±999999999999999.99	金额
4	BZ	Character	40		备注

9) 数据说明:

- (1) 相同 ZJZH (期权保证金账户) 可能会有多条记录, 相同 JELX (资金类型) 只有一条记录。
 (2) 保证金可用金额 = 账户余额 - 应交维持保证金金额 - 行权锁定保证金金额 - 备用金额。

4、op_ccbd (期权合约持仓变动数据文件)

- 1) 文件名称: op_ccbdXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
 2) 数据内容: 包括期权合约持仓变动数据。
 3) 文件生成单位: 清算编号。
 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
 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; '10': 上交所期权市场
2	QSBH	Character	5		清算编号
3	ZQZH	Character	10		证券账户

4	ZZHBM	Character	3		期权子账户编码 (固定填“888”)
5	TGDY	Character	5		#
6	HEYDM	Character	8		期权合约产品代码
7	CCFX	Character	1		持仓方向 (‘L’ 权利方持仓; ‘S’ 义务方持仓)
8	BDBZ	Character	1		备兑期权标志 (‘1’: Covered 备兑; ‘ ’ : Uncovered 非备兑;)
9	SLLX	Character	1		数量类型 ‘B’ : 余额
10	BDSL	Character	16	±9999999999999999	变动数量 (正数表示增加, 负数表示减少)
11	GHLX	Character	3		过户类型: ‘QG1’ 期权交易; ‘QG2’ 期权行权; ‘QG4’ 期权到期注销; ‘QG6’ 仓位对冲 ‘QG7’ 普通转备兑 ‘QG8’ 备兑转普通 (预留)
12	BDRQ	Character	8		变动日期
13	YWBH	Character	20		#
14	BY	Character	20		#

9) 数据说明:

行权时, 对应标的证券的变动文件, 通过现货系统 ZQBD (证券变动文件) 发送。

5、op_hycc (期权合约持仓数据文件)

- 1) 文件名称: op_hyccXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括期权合约持仓数据。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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; ‘10’: 上交所期权市场
2	QSBH	Character	5		清算编号
3	ZQZH	Character	10		证券账号

4	ZZHBM	Character	3		期权子账户编码 (固定填 '888')
5	TGDY	Character	5		#
6	HEYDM	Character	8		期权合约产品代码
7	CCFX	Character	1		持仓方向 ('L' 权利方持仓; 'S' 义务方持仓)
8	BDBZ	Character	1		备兑期权标志 ('1': Covered 备兑; ' ': Uncovered 非备兑;)
9	YE1	Character	16	±9999999999999999	期权合约持仓数量
10	YE2	Character	16	±9999999999999999	参与组合的期权合约持仓数量
11	JE1	Character	17	±99999999999999.99	#
12	JE2	Character	17	±99999999999999.99	#
13	BY	Character	20		#

6、op-jsmx (期权结算明细文件)

- 1) 文件名称: op-jsmxXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括期权交易结算、行权结算和费用等数据。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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	JLGS	Character	3		记录格式
2	SCDM	Character	2		市场代码
3	JLLX	Character	3		记录类型
4	JSFS	Character	3		交收方式
5	YWLX	Character	3		业务类型
6	QSBZ	Character	3		清算标志
7	JSBH	Character	16		交收编号
8	CJBH	Character	16	±9999999999999999	成交编号
9	HYDDBH	Character	10		券商订单编号
10	JYDDBH	Character	16		交易所订单编号
11	JYRQ	Character	8		交易日期
12	QSRQ	Character	8		清算日期
13	JSRQ	Character	8		交收日期
14	XWH1	Character	5		交易单元

15	XWH2	Character	5		结算单元
16	XWHY	Character	5		交易参与人的清算编号
17	JSHY	Character	5		结算参与人的清算编号
18	ZQZH	Character	10		证券账号
19	ZZHBM	Character	3		期权子账户编码
20	HEYDM	Character	8		期权合约产品代码
21	BDZQDM	Character	6		标的证券代码
22	MMBZ	Character	1		买卖标志
23	KPBZ	Character	1		开平标志
24	BDBZ	Character	1		备兑期权标志
25	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量 1
26	SL2	Character	16	±9999999999999999	数量 2
27	ZJZH	Character	25		资金账号
28	BZ	Character	3		币种
29	JG1	Character	17	±999999.9999999999	价格 1
30	JG2	Character	17	±999999.9999999999	价格 2
31	QSJE	Character	19	±9999999999999999.99	清算金额
32	JSF	Character	17	±9999999999999999.99	交易费
33	GHF	Character	17	±9999999999999999.99	过户费
34	JSSXF	Character	17	±9999999999999999.99	结算费
35	QTJE	Character	19	±9999999999999999.99	其它金额
36	SFJE	Character	19	±9999999999999999.99	收付金额
37	JGDM	Character	4		结果代码
38	FJSM	Character	40		附加说明
39	BY	Character	20		备用

9) 数据说明:

- (1) 发送的数据 DBF 字段全部定义为字符型, 对于数值型的信息用“±99999.99”这样的格式定义来表示, 有“±”表示该数值可以有正负号。
- (2) 对于字符型的信息, 如果字段长度 n 大于信息长度 m, 则填写字段的左起 m 位。
- (3) 表格中金额, 费用字段正数表示结算会员应收, 负数表示结算会员应付。

10) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	期权交易结算	期权行权指派明细	期权行权过户费明细
1	JLGS	记录格式	“F01”	“F02”	“F04”
2	SCDM	市场代码	“10” 上交所期权市场	“10” 上交所期权市场	“10” 上交所期权市场
3	JLLX	记录类型	“D01” 衍生品清算数据	“D01” 衍生品清算数据	“D01” 衍生品清算数据
4	JSFS	交收方式	“001” 净额担保	“001” 净额担保	“001” 净额担保
5	YWLX	业务类型	“Q01” 期权交易	“Q02” 期权行权	“Q02” 期权行权
6	QSBZ	清算标志	“QB1” 期权交易清算	“QB2” 期权行权清算	“QB3” 期权行权过户费
7	JSBH	交收编号	交收编号	#	交收编号
8	CJBH	成交编号	成交编号	#	#

9	HYDDBH	券商订单 编号	券商订单编号	#	#
10	JYDDBH	交易所订 单编号	交易所订单编号	#	#
11	JYRQ	交易日期	交易日期	行权申报日	#
12	QSRQ	清算日期	清算日期	行权清算日	清算日期
13	JSRQ	交收日期	交收日期	行权交收日	交收日期
14	XWH1	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
15	XWH2	结算单元	结算单元	结算单元	结算单元
16	XWHY	交易参与 人的清算 编号	交易参与人的清算编号	交易参与人的清算编号	交易参与人的清算编号
17	JSHY	结算参与 人的清算 编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号
18	ZQZH	证券账号	证券账号	证券账号	证券账号
19	ZZHBM	期权子账 户编码	固定填 “888”	固定填 “888”	固定填 “888”
20	HEYDM	期权合约 代码	期权合约产品代码	期权合约产品代码	#
21	BDZQDM	标的证券 代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
22	MMBZ	买卖标志	‘B’ 买方; ‘S’ 卖方;	‘B’ 行权方; ‘S’ 被行权方;	#
23	KPBZ	开平标志	‘O’ 开仓; ‘C’ 平仓;	#	#
24	BDBZ	备兑期权 标志	‘1’: Covered 备兑; ‘ ’: Uncovered 非备 兑;	‘1’: Covered 备兑; ‘ ’: Uncovered 非备 兑;	#
25	SL1	数量 1	合约数量 (单位: 张, 开仓为正, 平仓为负)	行权指派数量 (行权方、被行权方都 为负)	过户数量 (过入为正, 过出为负)
26	SL2	数量 2	#	标的证券收付数量 (正 数表示应收, 负数表示 应付)	#
27	ZJZH	资金账号	资金账号	资金账号	资金账号
28	BZ	币种	‘RMB’	‘RMB’	‘RMB’
29	JG1	价格 1	权利金成交价	行权价	#
30	JG2	价格 2	#	#	#
31	QSJE	清算金额	权利金金额	清算金额	#
32	JSF	交易费	交易费	交易费	#
33	GHF	过户费	过户费	过户费	过户费

34	JSSXF	结算费	结算费	结算费	#
35	QTJE	其它金额	其它金额	其它金额	#
36	SFJE	收付金额	收付金额=清算金额+交易费+过户费+结算费+其它金额;	收付金额=清算金额+交易费+过户费+结算费+其它金额;	收付金额=过户费;
37	JGDM	结果代码	“0000” 正常	“0000” 正常 “9999” 失败	“0000” 正常
38	FJSM	附加说明	期权交易结算	当结果代码为 “0000” 时, 填 “期权行权结算”; 当结果代码为 “9999” 时, 填 “行权分配失败”。	期权行权过户费
39	BY	备用	前三位表示订单所有类型 “ 1” =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	#	#

7、op-tzxx(衍生品通知信息文件)

- 1) 文件名称: op-tzxx.mdd。
- 2) 数据内容: 包含保证金不足平仓和期权备兑不足平仓等各类通知数据。
- 3) 文件生成单位: 结算参与人信箱。
- 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	TZLB	Character	3		通知类别
3	TZRQ	Character	8		通知日期
4	QSBH	Character	8		结算参与人的清算编号
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

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
10	ZH1	Character	25		账户 1
11	ZH2	Character	25		账户 2
12	RQ1	Character	8		日期 1
13	RQ2	Character	8		日期 2
14	JE1	Character	19	±999999999999999.99	金额 1
15	JE2	Character	19	±999999999999999.99	金额 2
16	JE3	Character	19	±999999999999999.99	金额 3
17	JG1	Character	17	9999999.999999999	价格 1
18	JG2	Character	17	9999999.999999999	价格 2
19	BL1	Character	17	9999999.999999999	比率 1
20	BL2	Character	17	9999999.999999999	比率 2
21	SL1	Character	16	±999999999999999	数量 1
22	SL2	Character	16	±999999999999999	数量 2
23	FZDM	Character	10		辅助代码
24	BZ	Character	80		备注
25	BY	Character	40		备用

9) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	保证金不足平仓通知	备兑不足平仓通知
1	SCDM	市场代码	10-上交所期权市场	10-上交所期权市场
2	TZLB	通知类别	“QP1”: 保证金不足平仓	“QP2”: 备兑不足平仓
3	TZRQ	通知日期	当日	当日
4	QSBH	结算参与人的清算编号	#	清算编号
5	ZQDM	证券代码	#	标的证券代码
6	ZQLB	证券类别	#	#
7	LTLX	流通类型	#	#
8	QYLB	权益类别	#	#
9	GPNF	挂牌年份	#	#
10	ZH1	账户 1	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
11	ZH2	账户 2	#	证券账号+期权子账户编码
12	RQ1	日期 1	通知日期	通知日期
13	RQ2	日期 2	#	
14	JE1	金额 1	维持保证金不足金额, 填正数	#
15	JE2	金额 2	#	#
16	JE3	金额 3	#	#
17	JG1	价格 1	#	#
18	JG2	价格 2	#	#
19	BL1	比率 1	#	#
20	BL2	比率 2	#	#
21	SL1	数量 1	#	标的证券应交备兑数量, 填正数

序号	字段名	说明	保证金不足平仓通知	备兑不足平仓通知
22	SL2	数量 2	#	标的证券备兑不足数量, 填正数
23	FZDM	辅助代码	#	#
24	BZ	备注	#	#
25	BY	备用	#	#

8、op-ywhb(衍生品业务回报文件)

- 1) 文件名称: op-ywhb.mdd
- 2) 数据内容: 包括各类衍生品登记结算业务的回报数据, 如通过PROP系统申报的各类衍生品业务回报数据。
- 3) 文件生成单位: 结算参与人。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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	JLGS	Character	3		记录格式
2	SCDM	Character	2		市场代码; “10”: 上交所期权市场
3	QSBH	Character	5		结算会员的清算编号
4	YWLX	Character	3		业务类型
5	YWLY	Character	2		业务来源
6	SBLX	Character	2		申报类型
7	JGDM	Character	4		结果代码
8	JGSM	Character	40		结果说明
9	SLBH	Character	20		受理编号
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	HYDM	Character	8		合约产品代码
15	CCFX	Character	1		持仓方向
16	BDBZ	Character	1		备兑标志
17	ZQDM	Character	6		证券代码
18	ZQLB	Character	2		证券类别
19	LT LX	Character	1		流通类型
20	QYLB	Character	2		权益类别
21	GPNF	Character	4		挂牌年份
22	FZDM	Character	10		辅助代码
23	ZQZH1	Character	10		证券帐号 1

序号	字段名	类型	长度	格式定义	说明
24	ZZHBM1	Character	3		期权子账户编码 1
25	ZQZH2	Character	10		证券帐号 2
26	ZZHBM2	Character	3		期权子账户编码 2
27	XWH1	Character	5		业务单元 1
28	XWH2	Character	5		业务单元 2
29	SBSL1	Character	16	±9999999999999999	申报数量 1
30	SBSL2	Character	16	±9999999999999999	申报数量 2
31	CGSL1	Character	16	±9999999999999999	成功数量 1
32	CGSL2	Character	16	±9999999999999999	成功数量 2
33	BCYE1	Character	16	±9999999999999999	本次余额 1
34	BCYE2	Character	16	±9999999999999999	本次余额 2
35	JE1	Character	19	±9999999999999999 .99	金额 1
36	JE2	Character	19	±9999999999999999 .99	金额 2
37	RQ	Character	8		日期
38	BCSM	Character	40		补充说明

9) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	行权指令合并申报回报数据
1	JLGS	记录格式	‘F24’
2	SCDM	市场代码;	‘10’: 上交所期权市场
3	QSBH	结算会员的清算编号	申报账户的结算会员清算编号
4	YWLX	业务类型	‘Q02’: 期权行权
5	YWLY	业务来源	#
6	SBLX	申报类型	#
7	JGDM	结果代码	‘0000’ 或 ‘9999’
8	JGSM	结果说明	‘0000’: 全部成功 ‘9999’: 未全部成功 (含部分失败和全部失败)
9	SLBH	受理编号	上交所 OrderID
10	SBBH	申报编号	券商订单编号 (前 10 位有效)
11	YHDM	用户代码	#
12	SBRQ	申报日期	申报日期
13	SBSJ	申报时间	申报时间
14	HYDM	合约产品代码	认购期权合约的编码
15	CCFX	持仓方向	‘L’: 权利仓
16	BDBZ	备兑标志	#
17	ZQDM	证券代码	#
18	ZQLB	证券类别	#
19	LTLX	流通类型	#
20	QYLB	权益类别	#

21	GPNF	挂牌年份	#
22	FZDM	辅助代码	认沽期权合约的编码
23	ZQZH1	证券帐号 1	期权合约账户
24	ZZHBM1	期权子账户编码 1	固定值（暂定 888）
25	ZQZH2	证券帐号 2	#
26	ZZHBM2	期权子账户编码 2	#
27	XWH1	业务单元 1	指定交易单元
28	XWH2	业务单元 2	#
29	SBSL1	申报数量 1	行权指令合并申报数量（份）
30	SBSL2	申报数量 2	#
31	CGSL1	成功数量 1	行权指令合并申报成功数量（份）
32	CGSL2	成功数量 2	#
33	BCYE1	本次余额 1	#
34	BCYE2	本次余额 2	#
35	JE1	金额 1	#
36	JE2	金额 2	#
37	RQ	日期	#
38	BCSM	补充说明	#

本文件不再包括期权合约账户开通注销业务回报数据，相关数据以中国结算统一账户平台发布《账户系统数据接口规范（供开户代理机构使用）》的说明为准。

9、op-zhcc(期权组合持仓明细数据文件)

- 1) 文件名称: op-zhccmxXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括期权组合持仓明细数据。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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	ZHBH	Character	16		组合编号
2	ZQZH	Character	10		期权合约账户
3	ZZHBM	Character	3		期权合约子账户编号
4	TGDY	Character	5		交易单元号
5	ZHCLBM	Character	8		组合策略编码
6	ZHFS	Character	10		组合份数
7	DWBZJ	Character	19	999999999999999.99	单位保证金
8	ZHCFS	Character	2		组合策略的成分合约数
9	HEYDM1	Character	8		第一个成分合约的合约编码
10	BDBZ1	Character	1		第一个成分合约的备兑期权标志

11	CCFX1	Character	1		第一个成分合约的持仓方向
12	HEYDM2	Character	8		第二个成分合约的合约编码
13	BDBZ2	Character	1		第二个成分合约的备兑期权标志
14	CCFX2	Character	1		第二个成分合约的持仓方向
15	HEYDM3	Character	8		第三个成分合约的合约编码
16	BDBZ3	Character	1		第三个成分合约的备兑期权标志
17	CCFX3	Character	1		第三个成分合约的持仓方向
18	HEYDM4	Character	8		第四个成分合约的合约编码
19	BDBZ4	Character	1		第四个成分合约的备兑期权标志
20	CCFX4	Character	1		第四个成分合约的持仓方向
21	BY	Character	20		#

10、op-zjjs (期权资金净额交收文件)

- 1) 文件名称: op-zjjs.mdd
- 2) 数据内容: 包括期权行权资金交收的交收通知和交收结果。
- 3) 文件生成单位: 结算参与人信箱。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 5) 发送时间: 每个行权申报日及交收日日终后。
- 6) 发送周期: 每个行权申报日及交收日。
- 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	JLGS	Character	3		记录格式
2	JLLX	Character	3		记录类型
3	JSFS	Character	3		交收方式
4	YWLX	Character	3		业务类型
5	QSBZ	Character	3		清算标志
6	JSBH	Character	16		交收编号
7	QSRQ	Character	8		清算日期
8	JSRQ	Character	8		交收日期
9	XWHY	Character	5		交易参与人的清算编号
10	JSHY	Character	5		结算参与人的清算编号
11	ZJZH	Character	25		资金账号
12	JE1	Character	19	± 99999999999999.99	金额 1
13	JE2	Character	19	± 99999999999999.99	金额 2
14	JE3	Character	19	± 99999999999999.99	金额 3
15	JE4	Character	19	± 99999999999999.99	金额 4
16	JGDM	Character	4		结果代码
17	FJSM	Character	40		附加说明
18	BY	Character	20		备用

- 9) 数据说明:

(1) 表格中金额, 费用字段正号表示结算会员应收, 负号表示结算会员应付。

10) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	期权行权资金净额交收通知 (按衍生品保证金账号汇总一条)	期权行权资金按清算编号汇总明细
1	JLGS	记录格式	“F21”	“F22”
2	JLLX	记录类型	“D02” 衍生品业务交收通知	“D02” 衍生品业务交收通知
3	JSFS	交收方式	“001” 净额担保	“001” 净额担保
4	YWLX	业务类型	“Q02” 期权行权	“Q02” 期权行权
5	QSBZ	清算标志	“QB2” 期权行权清算	“QB2” 期权行权清算
6	JSBH	交收编号	交收编号	#
7	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期
8	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期
9	XWHY	交易参与人的清算编号	#	#
10	JSHY	结算参与人的清算编号	#	清算编号
11	ZJZH	资金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
12	JE1	金额 1	行权交收净应收付金额。	行权交收净应收付金额。
13	JE2	金额 2	#	#
14	JE3	金额 3	#	#
15	JE4	金额 4	#	#
16	JGDM	结果代码	“0000” 正常	“0000” 正常
17	FJSM	附加说明	行权资金净额交收通知	行权资金按清算编号汇总明细
18	BY	备用	#	#

续上表:

序号	字段名	说明	期权行权资金交收结果
1	JLGS	记录格式	“F23”
2	JLLX	记录类型	“D03” 衍生品业务交收结果
3	JSFS	交收方式	“001” 净额担保
4	YWLX	业务类型	“Q02” 期权行权
5	QSBZ	清算标志	“QB2” 期权行权清算
6	JSBH	交收编号	交收编号
7	QSRQ	清算日期	清算日期
8	JSRQ	交收日期	交收日期
9	XWHY	交易参与人的清算编号	#
10	JSHY	结算参与人的清算编号	#

11	ZJZH	资金账户	衍生品保证金账户
12	JE1	金额 1	行权交收原净应收付金额。
13	JE2	金额 2	现金结算汇总金额
14	JE3	金额 3	行权交收实际收付金额
15	JE4	金额 4	欠款金额
16	JGDM	结果代码	“0000” 正常 “D102” 交收资金不足
17	FJSM	附加说明	行权资金交收结果
18	BY	备用	#

11、op-zqjs (期权证券净额交收文件)

- 1) 文件名称: op-zqjsXXXXX.mdd (XXXXX 为清算编号)
- 2) 数据内容: 包括期权行权证券净额交收的交收通知和交收结果、备兑期权标的证券锁定情况数据。
- 3) 文件生成单位: 清算编号。
- 4) 发送目标: 结算参与人信箱。
- 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	JLGS	Character	3		记录格式
2	JLLX	Character	3		记录类型
3	JSFS	Character	3		交收方式
4	YWLX	Character	3		业务类型
5	JSBH	Character	16		交收编号
6	GLJSBH	Character	16		关联交收编号
7	QSRQ	Character	8		清算日期
8	JSRQ	Character	8		交收日期
9	JYDY	Character	5		交易单元
10	JSDY	Character	5		结算单元
11	XWHY	Character	5		交易参与人的清算编号
12	JSHY	Character	5		结算参与人的清算编号
13	ZQZH	Character	10		证券账户
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	SL1	Character	16	±9999999999999999	数量 1
20	SL2	Character	16	±9999999999999999	数量 2

21	JG	Character	17	± 999999.999999999	价格
22	ZJZH	Character	25		资金账号
23	JE1	Character	19	± 999999999999.99	金额 1
24	JE2	Character	19	± 999999999999.99	金额 2
25	JGDM	Character	4		结果代码
26	FJSM	Character	40		附加说明
27	BY	Character	20		备用

9) 数据填写说明:

序号	字段名	说明	期权行权标的证券净额交收通知	期权行权标的证券净额交收结果	期权行权现金结算交收明细
1	JLGS	记录格式	“F11”	“F12”	“F13”
2	JLLX	记录类型	“D02” 衍生品业务交收通知	“D03” 衍生品业务交收结果	“D03” 衍生品业务交收结果
3	JSFS	交收方式	“001” 净额担保	“001” 净额担保	“001” 净额担保
4	YWLX	业务类型	“Q02” 期权行权	“Q02” 期权行权	“Q02” 期权行权
5	JSBH	交收编号	交收编号	交收编号	交收编号
6	GLJSBH	关联交收编号	#	#	原行权证券交收通知的交收编号
7	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
8	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
9	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
10	JSDY	结算单元	结算单元	结算单元	结算单元
11	XWHY	交易参与人的清算编号	交易参与人的清算编号	交易参与人的清算编号	交易参与人的清算编号
12	JSHY	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号
13	ZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
14	ZQDM	证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
15	ZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别
16	LTLX	流通类型	流通类型	流通类型	流通类型
17	QYLB	权益类别	权益类别	权益类别	权益类别
18	GPNF	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份

19	SL1	数量 1	行权交收标的证券净应收付数量。正数表示净应收，负数表示净应付	行权交收标的证券净应收付数量。正数表示净应收，负数表示净应付	采用现金结算的证券数量。正数表示投资者应收但采用现金结算的数量，负数表示投资者应付但采用现金结算的数量。
20	SL2	数量 2	#	行权交收证券实际收付数量。正数表示实收，负数表示实付。	0
21	JG	价格	#	#	现金结算价
22	ZJZH	资金账户	#	#	资金账户
23	JE1	金额 1	#	#	现金结算金额
24	JE2	金额 2	#	#	#
25	JGDM	结果代码	“0000” 正常	“0000” 正常 “D101” 证券部分交收	“0000” 正常
26	FJSM	附加说明	行权证券净额应收付	行权证券净额实收付	行权现金结算
27	BY	备用	#	#	#

续上表:

序号	字段名	说明	期权行权欠款扣券交收明细	备兑期权标的证券锁定情况	期权行权申报处置扣券及返还
1	JLGS	记录格式	“F14”	“F15”	“F16”
2	JLLX	记录类型	“D03” 衍生品业务交收结果	“D03” 衍生品业务交收结果	“D03” 衍生品业务交收结果
3	JSFS	交收方式	“001” 净额担保	“001” 净额担保	“001” 净额担保
4	YWLX	业务类型	“Q02” 期权行权	“Q07” 备兑期权标的证券锁定	“Q91” 期权行权处置申报 / “Q92” 期权处置申报返还
5	JSBH	交收编号	交收编号	#	#
6	GLJSBH	关联交收编号		#	原行权证券交收通知的交收编号
7	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
8	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
9	JYDY	交易单元	指定交易单元	指定交易单元	指定交易单元
10	JSDY	结算单元	结算单元	结算单元	结算单元
11	XWHY	交易参与人的清算编号	指定交易参与人的清算编号	指定交易参与人的清算编号	指定交易参与人的清算编号
12	JSHY	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号	结算参与人的清算编号

13	ZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
14	ZQDM	证券代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代码
15	ZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别
16	LTLX	流通类型	流通类型	流通类型	流通类型
17	QYLB	权益类别	权益类别	权益类别	权益类别
18	GPNF	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份	挂牌年份
19	SL1	数量 1	扣券数量 (正数)	锁定数量 (正数)	申报扣券数量 (负数) / 申报返还数量 (正数)
20	SL2	数量 2	#	#	实际扣券数量 (负数) / 实际返还数量 (正数)
21	JG	价格	扣券价格	#	#
22	ZJZH	资金账户	资金账户	#	#
23	JE1	金额 1	扣券市值	#	#
24	JE2	金额 2	#	#	#
25	JGDM	结果代码	“0000” 正常	“0000” 正常	“0000” 正常
26	FJSM	附加说明	行权欠款扣券	备兑期权证券实际 锁定情况	行权申报处置扣券/行权申 报扣券返还
27	BY	备用	#	#	处置扣券或返回的对手方 账户, 即券商行权处置大账 户

10) 数据说明:

对于期权行权申报处置扣券及返还业务 (记录类型为 F16), 期权行权处置申报日日终发送期权行权处置申报数据, 返还日发送期权处置申报返还数据。

1. 对于备兑期权标的证券锁定情况 (记录类型为 F15), 本文件可能包含未上市流通的送股和配股数据。

(二) 中国结算上海分公司向结算参与人发送的现货文件

1、qts1(证券其他数量对账文件)

1. 数据明细说明请参见登记结算数据接口规范 (结算参与人版)。
2. 期权业务填写说明:

字段名	长度	冻结 (含权利受限登记) 证券明细数量
SCDM	2	‘01’
HYDM	8	清算编号
SJLX	3	‘001’
ZQZH	10	证券账户
XWH	5	指定交易单元
ZQDM	6	证券代码
ZQLB	2	证券类别
LTLX	1	流通类型
QYLB	2	权益类别

字段名	长度	冻结 (含权利受限登记) 证券明细数量
GPNF	4	挂牌年份
SL1	16	冻结 (含权利受限登记) 数量
SL2	16	#
BH1	20	冻结序号
BH2	20	#
FZDM	3	冻结原因, 左起第一位。
RQ	8	该条冻结 (含权利受限登记) 明细最后一次变动的日期
BCSM	40	对于股票质押式回购业务, 本字段填写质权人名称, 左边 38 位有效, 右补空格; 对于其他业务, 本字段无效。
BY	20	对于股票质押式回购业务, 本字段填写质押登记编号, 左边 9 位有效, 右补空格; 对于其他业务, 本字段无效。

说明:

FZDM 字段第一位表示冻结原因, 定义如下:

“T”, 表示期权备兑开仓锁券冻结原因;

“V”, 表示被行权分配的到期备兑锁券和认沽期权行权有效申报方锁券;

2、tzxx (通知信息文件)

1. 数据明细说明请参见登记结算数据接口规范 (结算参与人版)。
2. 本文件包含衍生品保证金账户最低备付不足通知。

3、zqbd (证券变动文件)

1. 数据格式请参见登记结算数据接口规范 (结算参与人版)。
2. 期权业务填写说明:
 - 1) 期权行权交收时新增变动类型 (BDLX):
 - “140”, 表示期权行权交收引起的现券过户;
 - “141”, 表示期权行权证券申报处置的过户;
 - “142”, 表示期权行权处置证券返还的过户;
 - 2) 备兑开仓锁券引起的证券变动, 其变动类型 (BDLX) 同一般证券冻结的变动类型 (“00C”), 每个交易日先解冻 (变动类型为 “00D”), 然后再冻结 (变动类型为 “00C”)。参与人可以根据其它数量文件 (qts1) 中的冻结原因区分是否是备兑开仓锁券。
 - 3) 行权申报日, 认沽期权行权有效申报方锁券, 变动类型 (BDLX) 同一般证券冻结的变动类型 (“00C”), 行权交收日解锁 (变动类型 “00D”)。

4、zjbd (资金变动文件)

1. 数据明细说明请参见登记结算数据接口规范 (结算参与人版)。
2. 本文件包含衍生品保证金账户变动数据。

5、zjye (资金余额文件)

1. 数据明细说明请参见登记结算数据接口规范 (结算参与人版)。
2. 本文件包含衍生品保证金账户余额数据。

附录

常用数据字典说明：

1. 记录格式（JLGS）意义如下：

JLGS	说明
F01	期权交易结算
F02	期权行权指派明细
F04	期权行权过户费明细
F11	期权行权标的证券净额交收通知
F12	期权行权标的证券净额交收结果
F13	期权行权现金结算交收明细
F14	期权行权欠款扣券交收明细
F15	备兑期权标的证券锁定情况
F16	期权行权申报处置扣券及返还
F21	权行权资金净额交收通知（按衍生品保证金账号汇总一条）
F22	期权行权资金按清算编号汇总明细
F23	期权行权资金交收结果
F24	行权指令合并申报回报数据

2. 其他常用数据字典请参见登记结算数据接口规范（结算参与人版）