

H 股全流通业务之 券商技术系统变更指南 (Ver1.0)

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

深圳证券通信有限公司

二〇一九年十一月

关于本文档

文档名称	H 股全流通业务之券商技术系统变更指南	
说明		
版本修订历史		
日期	版本	修订说明
2019/05/07	Ver 1.0	创建文档

目录

一、	说明.....	4
二、	业务简介.....	4
2.1.	账户安排.....	4
2.2.	存管服务.....	5
2.3.	交易.....	6
2.4.	清算.....	6
2.5.	交收.....	7
三、	技术实现概况.....	7
3.1.	交易部分.....	7
3.1.1.	接入平台.....	7
3.1.2.	交易指令传输路径.....	7
3.2.	结算部分.....	8
3.2.1.	接入平台.....	8
3.2.2.	清算数据传输路径.....	8
3.2.3.	上行数据接口.....	8
3.2.4.	下行数据接口.....	8
3.3.	外汇还原申报部分.....	8
四、	交易数据接口.....	9
4.1.	接口概述.....	9
4.2.	接口规范文档.....	9
五、	结算数据接口.....	10
5.1.	接口概述.....	10
5.2.	境内结算参与人结算数据文件安排说明.....	10
5.3.	境外代理券商结算数据文件安排说明.....	12
5.4.	接口规范文档阅读指引.....	12
六、	联系方式.....	12

一、说明

为了指导市场参与者通过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”）开展 H 股全流通业务，中国结算深圳分公司会同深圳证券通信有限公司（以下简称“深证通”）专门编制和发布本指南，供相关市场参与者参考。

特别提示：如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。

二、业务简介

H 股全流通试点业务已顺利开展，为做好下一步工作准备，中国结算深圳分公司开展了系统优化工作。具体业务安排如下：

2.1. 账户安排

1、中国结算账户

中国结算深圳分公司继续使用其在境内结算银行处开立 H 股专用账户用于跨境资金划拨。使用现有 B 股港币备付金银行账户用于与结算参与人的港币资金交收，使用现有 A 股人民币备付金银行账户用于与结算参与人的人民币资金交收。

2、投资者证券账户

境内投资者使用 A 股证券账户记载 H 股股份的明细数据。投资者按照现行正常的账户开立流程，通过开户代理机构开立账户。该账户仅支持其初始持有的证券买卖，不支持其他证券的买卖。针对 H 股“全流通”股票权益分派、转换等情形取得联交所上市非 H 股“全流通”证券的，可以卖出，但不得买入；取得联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以卖出，但不得行权。境内证券公司应做好证券账户交易权限的控制。

3、境内证券公司的资金账户

境内券商需新开立港币备付金账户，用于港币资金交收，主要包括交易本金及与交易相关的税费、公司收购款、供配股款项等；新开立人民币备付金账户，用于人民币资金交收，主要包括存管类费用、红利款（如有）的交收。中国结算根据其账户余额结息。

4、境内券商在境外代理券商开设交易账户

境内券商需在境外代理券商开立交易账户，境内投资者以境内券商名义，通过其在境外代理券商的交易账户在港交所下达 H 股交易指令。

2.2. 存管服务

- 1、跨境转登记、境外集中存管、境内初始明细维护：跨境转登记流程与试点一致。股份转登记至境外后，中国结算将投资者持有的证券存管在香港子公司，香港子公司再将该部分证券集中存管于香港结算。境内初始明细维护流程与试点一致。
- 2、转托管：因外汇额度监控及境内外佣金调整等，拟不提供境内转托管服务。不提供跨境转托管服务。
- 3、非交易过户：与试点期间保持一致。
- 4、质押：中国结算不提供质押登记服务。境内证券公司向投资者提供质押服务的，可向中国结算提交质押锁定申请，中国结算对投资者相关证券进行质押锁定标记。
- 5、司法协助：与试点阶段做法保持一致。
- 6、公司行为：支持多项公司行为，包括：（1）投票，含现场投票；（2）人民币现金红利；（3）送股；（4）供股、公开配售、要约出售（港币）；（5）公司收购（港币）

2.3. 交易

交易时间由境内券商及境外代理券商共同确定，深证通提供订单路由的时点与港交所交易时间一致。交易日历为当两地均为交易日且满足结算安排的日期。

境内证券代码的编码方式与试点期间业务保持一致。

2.4. 清算

T 日，根据深证通提供的成交数据以及公司行为、非交易等相关参数进行清算，并将数据发送至境内结算参与人和境外代理券商。

1、交易清算

T 日日终，根据深证通转发的成交数据及香港市场的税费进行清算。对每笔交易，计算其印花税、交易费、交易征费、交易系统使用费、股份交收费（持续净额交收），计算每笔交易含税费的金额。境外代理券商的佣金拟通过向境内券商进行收取，并由境内券商直接划至境外

代理券商。

如发生投资者卖空，则对清算数据进行调整。对投资者当日的卖单根据成交时间顺序从后往前作无效处理，使投资者股份最多减至零。一笔成交可部分有效。在无效处理完成后开展对有效成交数据的资金清算处理。

对交收义务为应付的证券的资金，中国结算将于 $T+1$ 日（港股通交收日）上午 10:30 与境内结算参与人进行交收。对交收义务为应收的证券的资金，中国结算将于 $T+3$ 日（ $T+2$ 日港股通交收日的下一个港股通工作日）上午 10:30 完成与境内券商的资金交收。

2、公司行为清算

T 日日终，根据各类公司行为的相关参数进行港币或人民币清算，计算每个结算参与人的应收应付金额， $T+1$ 日 10:30 交收。

3、其他非交易清算

T 日日终，根据各类非交易数据开展非交易清算， $T+1$ 日 10:30 交收。

T 日日终，对一家境内券商的一只证券，根据其交易清算金额计算股份交收费（交收指令对盘）， $T+3$ 日 10:30 交收。

2.5. 交收

因增加买入功能，将调整资金交收时间。每个交收日上午 10:30，中国结算与境内结算参与人完成资金交收，包括： $T+1$ 日净应付资金、 $T+3$ 日净应收资金、公司行为资金及非交易业务资金。

境内证券交收为 $T+2$ 日日终，与香港市场保持一致，以保障投资者相关权益。

三、 技术实现概况

3.1. 交易部分

3.1.1. 接入平台

境内外市场参与机构与深证通跨境交易系统对接，并按照相关数据接口约定传输交易指令和成交回报。

3.1.2. 交易指令传输路径

根据业务规则和指南，H 股全流通的交易指令和成交回报的传输路径如下图：



图1：交易指令及成交回报的传输路径

3.2. 结算部分

3.2.1. 接入平台

结算参与机构通过 D-COM 与中国结算深圳分公司结算系统对接。上行数据主要有公司行为申报、非交易业务申报；下行数据主要为日终结算数据文件。

3.2.2. 清算数据传输路径

中国结算深圳分公司根据深证通转发的成交数据进行交易清算，并在日终向境内券商、境外代理券商分别发送清算数据，境内券商、境外代理券商应根据清算文件进行清算及核对。

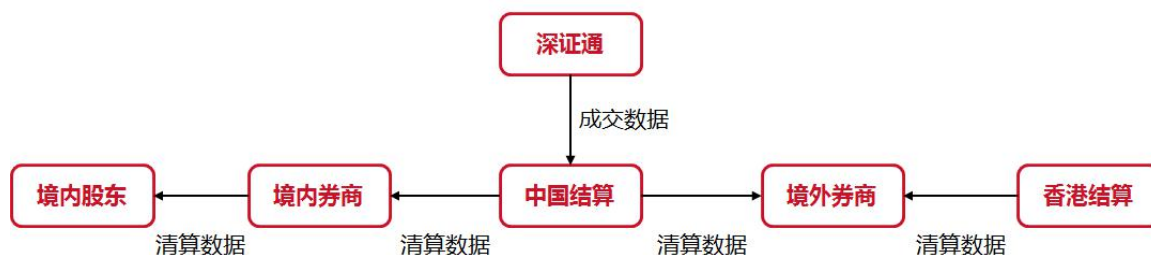


图2：清算数据流

3.2.3. 上行数据接口

上行数据接口主要包括公司行为及非交易业务申报。结算参与机构通过 D-COM 网关提供的 XML 实时报文接口进行申报，日间实时检查并返回结果，业务处理结果在日终通过清算数据文件反馈。

3.2.4. 下行数据接口

下行数据接口主要包括 H 股全流通日终结算数据文件，结算参与机构通过 D-COM 接收日终结算数据文件。

3.3. 外汇还原申报部分

境内券商通过 D-COM 上传外汇还原申报接口约定的 DBF 文件，在约定时点前可多次上传，中国结算深圳分公司以最后一次上传文件为准。中国结算深圳分公司收到外汇还原申报文件后，在与外汇申报银行的约定时点前，补充中国结算填报信息并通过 D-COM 转发外汇还原申报文件给外汇申报银行。



图3：外汇还原申报路径

四、交易数据接口

4.1. 接口概述

境内券商通过深证通传输订单向境外代理券商申报境内交易指令，境外代理券商在收到港交所的成交回报后，通过深证通将成交回报数据回传给境内券商。

境内外券商和以 DMA 方式接入的机构投资者，以 STEP 协议接入深证通跨境交易平台提交订单并获取执行报告。

4.2. 接口规范文档

接口规范文档参见《跨境业务 STEP 交易数据接口规范》，可从深证通网站 biz.sccc.com 的“业务指引”->“交易结算业务指引”->“程序下载”->“易境通交易通信系统技术文档”中下载。

五、 结算数据接口

5.1. 接口概述

(一) 境内结算参与人涉及技术变更的内容如下:

1. 上行数据

《深圳市场港股通、H 股全流通 XML 报文接口规范》包含 H 股全流通公司行为、H 股全流通冻结业务、H 股全流通电子投票和 H 股全流通现场投票, 其中公司行为、冻结业务技术操作方式与港股通对应业务相同, H 股全流通电子投票与现场投票为新增内容。

业务类别	H 股全流通	深市港股通	报文接口对比
公司行为	HKCAWT	HKCAWT	一致
冻结	HKDJWT	HKDJWT	一致
电子投票	HKTPWT	HKTPWT	H 股全流通新增证券代码字段
现场投票	HKTPWT	N/A	H 股全流通新增现场投票信息

表 1: H 股全流通与深市港股通报文接口对比

参与人除可使用 XML 报文接口规范对以上业务进行申报以外, 也可使用最新版本 D-COM 业务终端进行业务申报。

2. 下行数据

《H 股全流通结算数据接口规范》包含交易清算明细、非交易股份变动、资金汇总、对账等数据内容。

3. 外汇还原申报

《H 股跨境外汇报送数据接口规范》包含境内券商和外汇申报银行两部分内容。

(二) 境外代理券商涉及技术变更的内容如下:

1. 下行数据

《H 股境外指定交易券商结算数据接口规范》包含 H 股全流通交易清算明细文件和可交易额文件。

5.2. 境内结算参与人结算数据文件安排说明

H 股全流通的结算数据文件安排与深市港股通安排类似, 对比如下:

类别	文件名称	H 股全流通	深市港股通	说明
日终结算数据文件 (下行)	交易清算明细文件	H_SJSMX1	SZHK_SJSMX1	文件含交易清算明细数据; 数据接口含义上保持一致。其中 H_SJSMX1 中 CJBH 字段为 21 位, SZHK_SJSMX1 中 CJBH 字段为 18 位。
	证券组合费清算明细文件	N/A	SZHK_SJSMX2	H 股全流通无证券组合费清算数据。
	证券其他数量文件	H_QTSL	SZHK_QTSL	文件主要含对账类数据; 数据

				接口含义上保持一致。
	通知信息文件	H_TZXX	SZHK_TZXX	文件主要含公司行为通知数据；数据接口含义上保持一致。
	业务回报文件	H_YWHB	SZHK_YWHB	文件含对 D-COM 日间申报的日终反馈数据；数据接口含义上保持一致。
	证券变动文件	H_SJSJG	SZHK_SJSJG	文件主要含非交易股份变更及非交易资金数据；数据接口含义上保持一致。
	证券余额对账文件	H_SJSDZ	SZHK_SJSDZ	文件含股份对账数据；数据接口含义上保持一致。
	资金汇总文件	H_SJSQS	SZHK_SJSQS	文件含资金汇总数据；数据接口含义上保持一致。
	资金变动文件	H_SJSZJ	SZHK_SJSZJ	文件含资金变动数据；数据接口含义上保持一致。
	资金余额对账文件	H_SJSYE	SZHK_SJSYE	文件含资金对账数据；数据接口含义上保持一致。
	资金结息文件	H_SJSJX	SZHK_SJSJX	文件含资金结息数据；数据接口含义上保持一致。
	广播类信息文件	N/A	SZHK_SJSGB	广播类信息数据不单独发送，业务类别、权益类别、摘要代号等数据字典说明与深市港股通共用。
当日日终结算数据发送结束标志文件（下行）	数据发送标志文件，表示当日结算文件已经全部发送结束	N/A	END_SZHK.OK	H 股全流通数据接口与港股通数据接口同步下发，END_SZHK.OK 文件表示两类数据均发送完毕。

表 2：H 股全流通与深市港股通结算数据文件对比

5.3. 境外代理券商结算数据文件安排说明

类别	文件名称	说明
日终结算数据文件（下行）	交易清算明细文件 H_SJSMX	交易清算明细数据，用于清算数据核对。
	可交易额度文件 H_SJSJY	次日可交易股份数量，用于交易前端监控。

表 3：境外代理券商结算数据文件清单

5.4. 接口规范文档阅读指引

接口对象	接口文档
境内券商	《深圳市场港股通、H 股全流通 XML 报文接口规范》
	《H 股全流通结算数据接口规范》
	《H 股跨境外汇报送数据接口规范》
	《跨境业务 STEP 数据接口规范》
外汇申报银行	《H 股跨境外汇报送数据接口规范》
境外代理券商	《H 股境外指定交易券商结算数据接口规范》
	《跨境业务 STEP 数据接口规范》

表 4：接口规范文档阅读指引

六、 联系方式

中国结算深圳分公司：

业务咨询：0755-21899208

技术咨询：0755-25946080

电子邮箱：szjsb@chinaclear.com.cn

深圳证券通信有限公司：

技术咨询：0755-88665395

电子邮箱：hehm@sscc.com

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

深圳证券通信有限公司

2019 年 11 月 8 日