



中国结算工程技术文档

工程技术标准

H 股境外指定交易券商 结算数据接口规范 (Ver 1.2)



中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇一九年五月

文档信息

文档名称	H股境外指定交易券商结算数据接口规范		
编制者	中国结算深圳分公司技术开发部		
说明	用于B股转H股和H股全流通的境外交易券商与中国结算深圳分公司的数据交换		
修订历史 (REVISION HISTORY)			
Rev	Type	Date	Remarks
0.9	创建	2013/1/25	草稿
1.0		2013/2/7	征求境外券商意见后定稿
1.1		2018/1/2	配合H股全流通业务进行修改
1.2		2019/5/7	配合H股全流通业务进行修改

目 录

第一章 说明.....	1
第二章 数据交换处理过程与时间约定.....	3
2.1 B 股转 H 股.....	3
2.1.1 境外指定交易券商—>深圳分公司.....	3
2.1.2 深圳分公司—>境外指定交易券商.....	3
2.1.3 其他约定.....	4
2.2 H 股全流通.....	4
2.2.1 深圳分公司—>境外指定交易券商.....	4
第三章 数据接口定义.....	5
3.1 B 股转 H 股.....	5
3.1.1 成交明细库 HTXCJK.DBF.....	5
3.1.2 清算明细库 HTXQSK.DBF.....	5
3.1.3 成交明细卖空库 SJSMKKH.DBF.....	7
3.1.4 可交易股份数据库 SJSJYH.DBF.....	8
3.1.5 交收日安排 SJSJSRH.DBF.....	8
3.2 H 股全流通.....	9
3.2.1 交易清算明细文件 H_SJSMX.DBF.....	9
3.2.2 可交易额度文件 H_SJSJY.DBF.....	10

H 股境外指定交易券商

结算数据接口规范

第一章 说明

本文档用于描述中国证券登记结算公司深圳分公司（以下简称深圳分公司）在深市 B 股转换上市地以介绍方式在香港联交所上市及挂牌交易业务和 H 股全流通业务中对境外指定交易券商的结算数据接口，业务模式是中国结算在港交所充当境内投资者的托管人模式。

境外指定交易券商需要在深圳分公司开立结算账户，并与深圳证券通信公司联系数据通信事宜，安装综合结算通信平台 D-COM 用于相关数据的发送、接收。

本文中的资金结算货币为港币 HKD。

深圳分公司负责对本数据接口进行修订、解释。

《深市登记结算数据接口规范》可以通过中国证券登记结算公司网站（www.chinaclear.cn）下载。

http://www.chinaclear.cn/zdjs/jszsc/service_list.shtml

通讯地址:

深圳市福田区深南大道 2012 号深圳证券交易所广场 28 楼中国结算深圳分公司技术
开发部

邮政编码:

518038

联系电话:

0755-25946080

传真:

0755-25987633

电子邮箱:

szjsb@chinaclear.com.cn

第二章 数据交换处理过程与时间约定

2.1 B 股转 H 股

2.1.1 境外指定交易券商—>深圳分公司

所有深圳分公司收到的文件均以 H 开头。

境外指定交易券商在每日 16:30 前向深圳分公司传送当日成交明细 (HTXCJK. DBF)，用于深圳分公司向国内券商发送当日成交明细。一日内可重复发送，发送模式为覆盖模式。深圳分公司 16:30 定时收取该文件数据。

境外指定交易券商在每日 9:00 前向深圳分公司传送上一交易日的交易清算明细 (HTXQSK. DBF)，用于深圳分公司向国内券商发送应交收的交易清算明细，含各类税费。一日内可重复发送，发送模式为覆盖模式。深圳分公司 9:00 定时收取该文件数据。

以上数据是在香港的交易日进行数据发送。

2.1.2 深圳分公司—>境外指定交易券商

所有深圳分公司发送的文件均以 H 结尾。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送成交明细卖空库 (SJSMKKH. DBF) 和可交易股份数据库 (SJSJYH. DBF)。

如果当天没有卖空数据，则 SJSMKKH. DBF 是空库，无相关记录。

如果投资者当天没有可交易股份，则 SJSJYH. DBF 无相关记录。

境外指定交易券商需要在每个交易日上午 8:30 前通过 D-COM 收取最新的可交易股份数据库，用于当天股份的卖空监控。

深圳分公司在每日 18:30 前发送交收日安排 (SJSJSRH. DBF)，里面包含当年的深市 B 股全部交收日安排。

境外指定交易券商还会收到其他数据接口，包括但不限于 SJSGB. DBF。具体内容，请参见《深市登记结算数据接口规范》。

以上数据是在深圳的交易日进行数据发送。

2.1.3 其他约定

如果当天没有成交，境外指定交易券商仍需要按照约定上传空的成交明细库 (HTXCJK. DBF)。如果上一交易日没有成交，境外指定交易券商仍需要按照约定上传空的交易清算明细库 (HTXQSK. DBF)。

在港交所交易日时，如果港交所因台风等特殊原因临时不开市，境外指定交易券商仍需要按照以上约定上传库成交明细库 (HTXCJK. DBF) 和交易清算明细库 (HTXQSK. DBF)。

香港有半天交易安排的，当天也算香港交易日 (T 日)。

2.2 H 股全流通

2.2.1 深圳分公司—>境外指定交易券商

所有深圳分公司发送的文件均以“H_”作为文件名前缀。

深圳分公司在每日 18:00 前向境外指定交易券商发送交易清算明细文件 (H_SJSMX. DBF) 和可交易额度文件 (H_SJSJY. DBF)。

如果当天没有交易清算数据，则 H_SJSMX. DBF 是空库，无相关记录。

如果投资者次日没有可交易额度，则 H_SJSJY. DBF 无相关记录。

境外指定交易券商需要在每个交易日上午 8:30 前通过 D-COM 收取最新的可交易额度文件，用于当天股份的卖空监控。

以上数据是在深圳市场的交易日进行数据发送。

第三章 数据接口定义

以下所有接口文件均采用 FOXPRO2.5 的标准 DBF 文件格式。库中的文字编码要求：中文编码 GBK 规范，英文 ASCII 码。

3.1 B 股转 H 股

3.1.1 成交明细库 HTXCJK.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	CJKJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的 结算账户 必填项
2	CJKZQDH	证券代号	C	6	深市记录的 H 股证券代码， 不是联交所的证券代码 必填项
3	CJKCJHM	成交号码	C	8	境外指定交易券商编写的号码 必填项
4	CJKMFXH	卖方合同序号	C	22	国内券商报盘时的原委托序号 必填项
5	CJKMFGD	卖方股东代码	C	10	深市证券账户 必填项
6	CJKCJSL	成交数量	N	9,0	必填项
7	CJKCJJG	成交价格	N	9,3	必填项
8	CJKFSRQ	发送日期	D		格式为 CCYYMMDD，必填项

(1) 本库由境外指定交易券商发送深圳分公司。

(2) 深圳分公司在当日将此数据转发给境内券商。

3.1.2 清算明细库 HTXQSK.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	MXJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的结算账户 必填项
2	MXYWLB	业务类别	C	2	‘00’ 表示交收明细通知

					必填项
3	MXZQDM	证券代码	C	6	深市记录的 H 股证券代码 必填项
4	MXJYXW	交易单元	C	6	境内券商交易单元 必填项
5	MXXWDM	交易单元	C	6	空
6	MXGDDM	股东代码	C	10	深市证券账户 必填项
7	MXWTXH	委托序号	C	8	国内券商填报的委托序号 必填项
8	MXCJHM	成交号码	C	8	境外指定交易券商编写的号码 必填项
9	MXCJSL	成交数量	N	12, 0	每一笔成交委托的成交数量 必填项
10	MXQSSL	清算数量	N	12, 0	与成交数量相同 必填项
11	MXCJJG	成交价格	N	15, 9	每一笔委托之成交回报的成交均价（一笔交易委托可能对应多笔成交） 必填项
12	MXQSJG	清算价格	N	15, 9	与成交价格相同 必填项
13	MXHBDH	货币代号	C	3	“HKD” 必填项
14	MXQSBJ	清算本金	N	17, 2	SUM(每笔成交回报的成交价格×成交数量) 必填项
15	MXYHS	印花税	N	12, 2	H 股印花税 必填项
16	MXJYF	交易经手费	N	12, 2	H 股交易费 必填项
17	MXJGGF	监管规费	N	12, 2	H 股交易征费 必填项
18	MXGHF	过户费	N	12, 2	无，填 0
19	MXJSF	结算费	N	12, 2	H 股结算费 必填项
20	MXSXF	手续费	N	12, 2	境外指定交易券商佣金， 必填项
21	MXQTFY	其他费用	N	12, 2	无，填 0
22	MXZJJE	资金金额	N	17, 2	无，填 0
23	MXSFJE	收付净额	N	18, 2	所有金额的代数和 必填项

24	MXCJRQ	成交日期	D		实际交易日期, T 日 格式为 CCYYMMDD, 必填项
25	MXQSRQ	清算日期	D		T+1 日 格式为 CCYYMMDD, 必填项
26	MXJSRQ	交收日期	D		T+2 日 格式为 CCYYMMDD, 必填项
27	MXFSRQ	发送日期	D		发送日, T+1 日 格式为 CCYYMMDD, 必填项
28	MXBYBZ	备用标志	C	1	备用。

(1) 本库由境外指定交易券商发送深圳分公司。

(2) 本库表示应在交收日完成资金划付的交易清算明细, 含各类税费。每笔记录按成交委托进行清算。具体清算算法由境外指定交易券商负责解释。

(3) 深圳分公司将此数据转发给境内券商。

(4) 投资者应收金额应为正数, 应付金额为负数。

3.1.3 成交明细卖空库 SJSMKKH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	CJKJSZH	结算账户	C	6	境外指定交易券商的 结算账户 必填项
2	CJKZQDH	证券代号	C	6	深市登记的 H 股证券代码, 不是联交所的证券代码 必填项
3	CJKCJHM	成交号码	C	8	境外指定交易券商编写的号 码 必填项
4	CJKMFXH	卖方合同序号	C	22	国内券商报盘时的原委托序 号 必填项
5	CJKMFGD	卖方股东代码	C	10	深市证券账户 必填项
6	CJKCJSL	成交数量	N	9, 0	必填项
7	CJKCJJG	成交价格	N	9, 3	必填项
8	CJKBQYE	成交前余额	N	12, 0	
9	CJKBHYE	成交后余额	N	12, 0	为负
10	CJKFSRQ	发送日期	D		格式为 CCYYMMDD, 必填项

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 深圳分公司在 T 日检查成交明细库 HTXGJK，如果发现成交数量将导致投资者卖空，则将会卖空的成交反馈该境外指定交易券商。

3.1.4 可交易股份数据库 SJSJYH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	DZJSZH	结算账户	C	6	
2	DZXWDM	交易单元	C	6	
3	DZZQDM	证券代码	C	6	
4	DZGDDM	证券账户	C	10	
5	DZZYGS	总持股数	N	12,0	
6	DZFSRQ	发送日期	D		CCYYMMDD
13	DZBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库是境外指定交易券商用于次日卖出进行前端监控使用。

(3) 如果没有可卖出的股份，就没有相关记录。

3.1.5 交收日安排 SJSJSRH.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	GZRRQRQ	日期	D		
2	GZRBGBZ	B 股工作标志	C	1	Y: 是 B 股工作日 N: 不是 B 股工作日
3	GZRJSBZ	B 股交收标志	C	1	Y: 是 B 股交收日 N: 不是 B 股交收日
4	GZRFSRQ	发送日期	D		

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库用于境外指定交易券商参考深交所 B 股交易和交收安排。

(3) 如果发送日期为当年的倒数第三个工作日，则还会发送下一年全部交收日。

3.2 H 股全流通

3.2.1 交易清算明细文件 H_SJSMX.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	06: H 股全流通
2	JYFS	交易方式	C	2	02: 经深证通
3	JSFS	交收方式	C	1	H: 代收付
4	YWL B	业务类别	C	4	JY00-H 股全流通交易 (含大宗交易)
5	ZQLB	证券类别	C	2	F0: H 股全流通股票 F1: H 股全流通供配股权证 F2: H 股全流通其他权证
6	QSLSH	清算流水号	C	16	前 6 位为日期, 后 10 位为当日数字编号
7	CJBH	成交编号	C	21	港交所执行编号
8	WTBH	委托编号	C	16	委托编号
9	JYRQ	交易日期	C	8	YYYYMMDD
10	QSRQ	清算日期	C	8	YYYYMMDD
11	JSRQ	交收日期	C	8	清算日期对应下两个港股通交收日
12	QTRQ	其它日期	C	8	YYYYMMDD
13	CJSJ	成交时间	C	6	深证通确定的成交时间 HHMMSS
14	JYDY	交易单元	C	6	交易单元
15	TGDY	托管单元	C	6	托管单元
16	JSZH	结算账号	C	8	左 6 位有效, 左对齐
17	ZQZH	证券账户代码	C	20	左 10 位有效, 左对齐
18	ZQDM1	证券代码 1	C	8	左 6 位有效, 左对齐
19	ZQDM2	证券代码 2	C	8	
20	CJSJ	成交数量	N	20, 3	单位为股 (份) 正数表示境内结算参与人应收数量 负数表示境内结算参与人应付数量
21	CJJG	成交价格	N	18, 10	单位为清算币种/股 (份), 如 HKD/股
22	JG2	价格 2	N	18, 10	
23	QSSL	清算数量	N	20, 3	单位为股 (份) 正数表示境内结算参与人应收数量 负数表示境内结算参与人应付数量 清算数量为 0, 表示卖空导致整笔交易无效; 清算数量不为 0 且不等于成交数量, 表示该笔交易部分卖空, 清算数量即

					为有效部分。
24	WBJE	外币清算金额	N	19, 2	正数表示境内结算参与人应收金额 负数表示境内结算参与人应付金额
25	ZJZH	资金账户	C	25	左 10 位有效, 左对齐
26	YHS	印花税	N	19, 2	负数, 表示境内结算参与人应付金额
27	JYZF	交易征费	N	19, 2	负数, 表示境内结算参与人应付金额
28	JYF	交易费	N	19, 2	负数, 表示境内结算参与人应付金额
29	SYF	交易系统使用费	N	19, 2	负数, 表示境内结算参与人应付金额
30	JSF	股份交收费	N	19, 2	负数, 表示境内结算参与人应付金额
31	QTJE	其它金额	N	19, 2	正数表示境内结算参与人应收金额 负数表示境内结算参与人应付金额
32	WBYSF	外币应收付金额	N	19, 2	正数表示境内结算参与人应收金额 负数表示境内结算参与人应付金额
33	QSBZ	清算币种	C	3	
34	HL	汇率	N	18, 10	
35	YSFJE	人民币应收付金额	N	19, 2	
36	CWDH	错误代号	C	4	
37	FJSM	附加说明	C	40	
38	FSRQ	发送日期	C	8	

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库表示应在交收日完成资金划付的交易清算明细, 含各类税费。每笔记录按成交委托进行清算。具体清算算法参照相关业务指南。

3.2.2 可交易额文件 H_SJSJY.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JSZH	结算账号	C	8	左 6 位有效, 左对齐
2	TGDY	托管单元	C	6	托管单元
3	ZQDM	证券代码	C	8	境内证券代码, 左 6 位有效, 左对齐
4	ZQZH	证券账户代码	C	20	左 10 位有效, 左对齐
5	KJYE	可交易额	N	20, 3	单位为股 (份), 正整数
6	FSRQ	发送日期	C	8	YYYYMMDD
7	BYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库由深圳分公司发送境外指定交易券商。

(2) 本库是境外指定交易券商用于次日卖出进行前端监控使用。

(3) 如果没有可卖出的股份, 就没有相关记录。