

北京市场货银对付改革技术实施指引

(正式版)



中国证券登记结算有限责任公司北京分公司

二〇二二年六月

版本说明

修订日期	版本	修订说明
2022 年 1 月	开发版	形成北京市场货银对付改革技术实时指引（开发版）
2022 年 6 月	正式版	3.7 节中，违约处置证券划转数据启用摘要代号‘M61’，以便于同其它的股份调帐业务进行区分。

目 录

一. 说明.....	1
二. 接口修订概述.....	1
三. 接口修订说明.....	2
3.1 模拟期可售交收锁定结果库 BJSVDPJG.DBF.....	2
3.2 T+0 预清算资金汇总库 BJSQS0.DBF.....	2
3.3 日间多批次交收结果库 BJSDDPC.DBF.....	7
3.4 明细结果库 BJSJG.DBF.....	8
3.5 交收指令上行库 JSZLSXX.DBF.....	12
3.6 交收指令下行库 JSZLXXX.DBF.....	14
3.7 清算明细库 BJSMX1.DBF.....	15
3.8 综合数据服务库 BJSFW.DBF.....	15
四. 联系方式.....	17

一. 说明

为方便市场参与各方更好地完成北京市场证券登记结算业务货银对付改革相关技术准备工作，中国证券登记结算有限责任公司北京分公司制定本文档，供市场参与各方及其技术供应商变更技术系统时参考。

本指引中未涉及的详细内容请参见《中国结算北京市场数据接口规范(Ver1.0)》。如果业务规则及业务方案有所变更，本指引也可能会有所变更，届时将另行通知。

请市场参与各方根据自身需要，参照本指引的相应内容，做好相关的技术准备工作。

二. 接口修订概述

本次接口修订内容概述如下：

(1) 增加模拟期可售交收锁定结果库 BJSVPIG.DBF，用于在模拟期内发送模拟计算出的可售交收锁定证券数量，供结算参与人参考，详见 3.1 节的说明。模拟期结束后，该接口不再发送。

(2) 新增 T+0 预清算资金汇总库 BJSQS0.DBF，用于在 T 日日间向参与人分三批次发送预清算数据，详见 3.2 节的说明。

(3) 新增日间多批次交收结果库 BJSIPC.DBF，用于在 T+1 日日间向参与人分三批次发送交收结果，详见 3.3 节的说明。

(4) 明细结果库 BJSJG.DBF 增加可售交收锁定数据和待处置交收锁定数据，详见 3.4 节的说明。

(5) 优先标识指令、免除标识指令、待处置锁定指令的申报接口请参见 3.5 和 3.6 节的说明。除接口申报方式外，结算参与人也可以通过 CCNET 终端界面进行指令填写和申报。

(6) 由于交收模式的变化，原清算明细库 BJSMX1 中业务类别为‘00’的交易清算明细数据对应的交收方式含义发生变化，详见 3.7 节的说明。

(7) 根据新修订的结算备付金管理规则，对最低结算备付金限额业务相关接口数据填写方式进行了调整，相关接口变化详见 3.8 节的说明。

根据业务安排，本次修订涉及的接口将分步启用，模拟期仅新增模拟期可售

交收锁定结果库 BJSVDPJG.DBF, 其余接口均在模拟期结束后启用, 届时将另行通知。

三. 接口修订说明

3.1 模拟期可售交收锁定结果库 BJSVDPJG.DBF

根据业务安排, 模拟期内暂不进行可售交收锁定, 但登记结算系统将根据资金核验情况模拟计算可售交收锁定证券数量, 并于日终通过新增的 BJSVDPJG.DBF 接口发送给结算参与人, 具体填写说明如下:

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	JGJSZH	结算账号	C	6	
2	JGBFZH	备付金账户	C	10	
3	JGZQDM	证券代码	C	6	
4	JGGFXZ	股份性质	C	2	
5	JGZQZH	证券账户	C	10	
6	JGTGDY	托管单元	C	6	
7	JGJSSL	交收数量	N	12, 0	>0, 锁定数量
8	JGFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD

说明: (1) 对于经纪、融资融券业务, 模拟期不会发送该数据。(2) 模拟期结束后, 本库不再发送。

3.2 T+0 预清算资金汇总库 BJSQS0.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	QSSJLX	数据类型	C	2	
2	QSYWLB	业务类别	C	4	
3	QSZJZH	备付金账户	C	10	
4	QSZQDM	证券代码	C	6	
5	QSTGDY	托管单元	C	6	
6	QSJSZH	结算账号	C	6	

7	QSSFJE	收付金额	N	17,2	
8	QSMRJE	买入金额	N	17,2	
9	QSMCJE	卖出金额	N	17,2	
10	QSYHS	印花税	N	17,2	
11	QSJGGF	监管规费	N	17,2	
12	QSJFXJ	结算风险金	N	17,2	
13	QSJSF	结算费	N	17,2	
14	QSGHF	过户费	N	17,2	
15	QSJYJSF	交易经手费	N	17,2	
16	QSSXF	手续费	N	17,2	
17	QSZJE1	资金金额 1	N	17,2	
18	QSZJE2	资金金额 2	N	17,2	
19	QSZJE3	资金金额 3	N	17,2	
20	QSJSFS	交收方式	C	1	
21	QSCJRQ	成交日期	D	8	CCYYMMDD
22	QSQSRQ	清算日期	D	8	CCYYMMDD
23	QSJSRQ	交收日期	D	8	CCYYMMDD
24	QSFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD
25	QSZQDM2	证券代码 2	C	6	保留字段
26	QSTGDY2	托管单元 2	C	6	保留字段
27	QSFJSM	附加说明	C	30	辅助信息
28	QSBYZD	备用字段	C	20	保留字段
29	QSBYBZ	备用标志	C	1	参与者系统自用

(1) 本库用于发送纳入 T 日清算净额的资金汇总清算数据，每天日间分三个批次（分别在 14:30、15:00、15:30 后）发送，每一批次覆盖前一批次数据。根据不同业务类别，定义不同字段的含义。具体清算业务含义请参见下表。

业务类别	业务类别含义
------	--------

JY00	采用担保交收模式的交易
QSHY	资金核验净应付金额（预估）

(2) QSSJLX（字段 1：数据类型）为该笔记录的数据类型，BJSQS0.DBF 包括两种类型的数据：‘DB’表示担保交收汇总清算数据；‘TZ’为“通知”类数据。

(3) QSZJZH（字段 3：备付金账户）为参与人在结算系统开立的备付金账户。

(4) QSZQDM（字段 4，证券代码），指该笔资金发生所涉及的证券代码。若填写 2 位则为证券类别，若为 6 位则为证券代码。若有的资金发生并不涉及证券代码时，本字段填写空。

(5) 所有资金字段（字段 7~19），如果大于零，则表示该结算参与者应收资金，否则表示应付资金。如无特殊说明，QSSFJE（字段 7，收付金额）为其余资金字段的代数和（字段 8~19）。QSZJJE1、QSZJJE2、QSZJJE3（字段 17、18、19，资金金额 1、2、3）为其它费用字段。

(6) QSJSFS（字段 20，交收方式），表示交收方式：‘Y’表示担保净额交收。

(7) QSCJRQ（字段 21，成交日期），表示委托日期。

(8) QSQRQ（字段 22，清算日期），表示清算处理的日期。

(9) QSFJSM（字段 27，附加说明），填写辅助信息。

其中业务类别为‘JY00’（采用担保交收模式的交易）的数据包含按照托管单元和证券类别汇总的清算金额，填写说明如下：

字段名	字段描述	业务类别	说明
		JY00	
QSSJLX	数据类型	DB	担保交收汇总清算数据
QSYWLB	业务类别	JY00	
QSZJZH	备付金账户	备付金账户	
QSZQDM	证券代码	证券类别	
QSTGDY	托管单元	托管单元	

QSJSZH	结算账号	结算账号	
QSSFJE	收付金额	收付金额	
QSMRJE	买入金额	买入金额	
QSMCJE	卖出金额	卖出金额	
QSYHS	印花税	印花税	
QSJGGF	监管规费		
QSJFXJ	结算风险金		
QSJSF	结算费	结算费	
QSGHF	过户费	交易过户费	
QSJYJSF	交易经手费	交易经手费	
QSSXF	手续费		
QSZJE1	资金金额 1		
QSZJE2	资金金额 2		
QSZJE3	资金金额 3		
QSJSFS	交收方式		
QSCJRQ	成交日期		
QSQSRQ	清算日期	T 日	
QSJSRQ	交收日期		
QFSRQ	发送日期	T 日	
QSZQDM2	证券代码 2		
QSTGDY2	托管单元 2		
QSFJSM	附加说明		
QSBYZD	备用字段		
QSBYBZ	备用标志	发送批次	发送批次为 1, 2, 3

说明：对于申请开通了结算数据抄送业务的资产管理人，结算系统将抄送上述业务类别为‘JY00’的数据至管理人。

业务类别为‘QSHY’（资金核验净应付金额（预估））的数据包含按照备付金账户汇总的资金核验净应付金额，填写说明如下：

字段名	字段描述	业务类别	说明
		QSHY	
QSSJLX	数据类型	TZ	“通知”类数据
QSYWLB	业务类别	QSHY	
QSZJZH	备付金账户	备付金账户	
QSZQDM	证券代码		
QSTGDY	托管单元		
QSJSZH	结算账号	结算账号	
QSSFJE	收付金额	资金核验净应付金额（预估）	资金核验净应付金额（预估）=min（0，清算金额）
QSMRJE	买入金额	0	
QSMCJE	卖出金额	0	
QSYHS	印花税	0	
QSJGGF	监管规费	0	
QSJFXJ	结算风险金	0	
QSJSF	结算费	0	
QSGHF	过户费	0	
QSJYJSF	交易经手费	0	
QSSXF	手续费	0	
QSZJE1	资金金额 1	清算金额	按备付金账户汇总的预清算数据的净应收或应付金额，正数代表净应收，负数代表净应付
QSZJE2	资金金额 2		
QSZJE3	资金金额 3		
QSJSFS	交收方式		

QSCJRQ	成交日期		
QSQSRQ	清算日期	T 日	
QSJSRQ	交收日期		
QSFSRQ	发送日期	T 日	
QSZQDM2	证券代码 2		
QSTGDY2	托管单元 2		
QSFJSM	附加说明		
QSBYZD	备用字段		
QSBYBZ	备用标志	发送批次	发送批次为 1, 2, 3

3.3 日间多批次交收结果库 BJSRPC.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	DPCJSZH	结算账号	C	6	
2	DPCBFZH	备付金账户	C	10	
3	DPCJSZT	解锁状态	C	1	“N”：未解锁 “0”：日初无可售交收 锁定 “1”：第一批次解锁 “2”：第二批次解锁 “3”：第三批次解锁
4	DPCFSPC	发送批次	C	1	“1”：第一批次 “2”：第二批次 “3”：第三批次
5	DPCFSRQ	发送日期	D	8	CCYYMMDD

(1) 该库每天日间分三个批次（分别在 9 点、10 点、12 点后）覆盖发送，每一批次包含前一批次的解锁数据，供参与人解除可售交收锁定时参考。

(2) 解锁状态 N 表示截止当前批次尚未解锁, 1、2、3 分别表示当天是在第几批次解锁, 对于日间三批次交收都未解锁的可售交收锁定, 日终会自动解锁或转成待处置交收锁定, 不再下发日终批次的交收结果。

(3) 发送批次字段表示该数据是第几个批次发送的数据。

3.4 明细结果库 BJSJG.DBF

(1) 锁定股份变更数据

BJSJG.DBF 中, 新增 7K、7L 业务类别, 分别表示待处置交收锁定和解除锁定的变更数据, 字段含义详见下表:

字段名	业务类别	
	7K (股份待处置交收锁定)	7L (股份待处置交收锁定解除)
JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	结算备付金账户	结算备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'7K'	'7L'
JGZQDM	证券代码	证券代码
JGJYXW		
JGXWDM	托管单元	托管单元
JGGDDM	证券账户	证券账户
JGWTXH		
JGCJHM		
JGQSLS		
JGCJSL		
JGQSSL		
JGJSSL	>0 待处置交收锁定股数	>0 待处置交收锁定解除股数
JGCJJG		
JGQSJG		

JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	证券类别	证券类别
JGGFXZ	股份性质	股份性质
JGJSFS		
JGHBDH		
JGQSBJ		
JGYHS		
JGJYF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE		
JGJSBZ	‘Y’	‘Y’
JGZYDH		
JGCJRQ	T 日	T 日
JGQSRQ		
JGJSRQ		
JGFSRQ	T 日	T 日
JGSCDM		
JGJYFS		
JGZQDM2		
JGFJSM		
JGBYBZ		

(2) 锁定股份通知类数据

BJSJG.DBF 中，新增 BC、BD 业务类别，分别表示当前系统中所有可售交收锁定和待处置交收锁定余额明细数据，字段含义详见下表：

字段名	业务类别	
	BC(可售交收锁定股份余额)	BD(待处置交收锁定股份余额)
JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	结算备付金账户	结算备付金账户
JGSJLX	'02'	'02'
JGYWLB	'BC'	'BD'
JGZQDM	证券代码	证券代码
JGJYXW		
JGXWDM	托管单元	托管单元
JGGDDM	证券账户	证券账户
JGWTXH		
JGCJHM		
JGQSLS		
JGCJSL		
JGQSSL		
JGJSSL	>0 可售交收锁定股份总额	>0 待处置交收锁定股份总额
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB		
JGGFXZ	股份性质	股份性质
JGJSFS		

JGHBDH		
JGQSBJ		
JGYHS		
JGJYF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE		
JGJSBZ	‘N’	‘N’
JGZYDH		
JGCJRQ	T 日	T 日
JGQSRQ		
JGJSRQ		
JGFSRQ	T 日	T 日
JGSCDM		
JGJYFS		
JGZQDM2		
JGFJSM		
JGBYBZ		

(3) 违约处置证券划转数据

若因资金交收违约相关待处置交收锁定证券被划转至专用清偿证券账户，相应划转结果将通过明细结果库 BJSJG.DBF 中业务类别 ‘41’（股份调账）的数据发送，**JGZYDH** 字段内容为 ‘M61’ 表示违约处置过户，具体字段说明请参见《中国结算北京市场数据接口规范 (Ver1.0)》。

3.5 交收指令上行库 JSZLSXK.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SXGNDM	功能代码	C	4	必填
2	SXJSZH	结算账号	C	6	必填
3	SXMXZH	备付金账号	C	10	必填
4	SXZQZH	证券账号	C	10	必填
5	SXXWDM	托管单元	C	6	必填
6	SXZQDM	证券代码	C	6	选填
7	SXZQSL	证券数量	N	12, 0	选填
8	SXZJJE	资金金额	N	17, 2	预留字段
9	SXSQRQ	申请日期	D	8	CCYYMMDD
10	SXSQSJ	申请时间	C	8	HHMMSSXX
11	SXSQSL	申请流水	C	10	当日唯一
12	SXCXLS	撤销流水	C	10	
13	SXQSJL	起始记录	N	8, 0	预留字段
14	SXYWRQ	业务日期	D	8	预留字段 CCYYMMDD
15	SXCLBZ	处理标志	C	1	
16	SXTXXZ	通信小站	C	16	
17	SXBYZD	备用字段	C	50	预留字段

(1) 参与者可以在每交易日的 8:30~17:00 通过 CCNET 终端进行优先标识指令、免除标识指令、待处置锁定指令的申报和撤销等操作。也可通过本接口库采用系统对接方式直接进行上述指令的申报和撤销。

(2) SXGNDM (功能代码), 含义详见下表:

功能代码含义表

SXGNDM	交易代码含义	请求响应方式
7010	新增优先标识指令	单笔申请单笔响应
7110	撤销优先标识指令	单笔申请单笔响应
7020	新增免除标识指令	单笔申请单笔响应

SXGNM	交易代码含义	请求响应方式
7120	撤销免除标识指令	单笔申请单笔响应
7030	新增待处置锁定指令	单笔申请单笔响应
7130	撤销待处置锁定指令	单笔申请单笔响应

(3) SXSQSL(申请交易流水), 交易流水号, 由交易申请方生成且当日内不得重复。流水号只可以由英文字母或阿拉伯数字组成, 由参与人根据实际需求确定生成方式, 若不足 10 位, 则右对齐左补空格。

(4) SXCXLS(撤销交易流水), 撤销交易中填写被撤销交易的原申请流水。

(5) SXSQRQ(申请日期), 交易申请日期。

(6) SXSQSJ(申请时间), HH 表示小时, MM 表示分钟, SS 表示秒钟, XX 备用, 一般写 00。对于响应类交易, 该字段填写其所对应的原申请交易时间。

(7) SXCLBZ(处理标志)表明本记录的处理状态。对于新的上行记录, 其初始值由用户系统置为‘z’; CCNET 通信程序会对上行数据进行逐条检查, 将发送成功的记录设置为‘1’, 将不成功的记录根据错误类型设置不同的错误代码。错误代码请参见下表。

处理标志错误代码表

序号	错误代码	错误描述
1	A	结算账号错误
2	B	资金金额格式错误
3	C	申请流水格式错误
4	E	撤销流水格式错误
5	F	申请日期格式错误或者不为当天
6	G	申请时间格式错误
7	H	证券数量格式错误
8	J	起始记录格式错误
9	U	业务日期格式错误

3.6 交收指令下行库 JSZLXXK.DBF

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	XXGNDM	功能代码	C	4	
2	XXJSZH	结算账号	C	6	
3	XXMXZH	备付金账号	C	10	
4	XXZQZH	证券账号	C	10	
5	XXXWDM	托管单元	C	6	
6	XXZQDM	证券代码	C	6	
7	XXZQSL	证券数量	N	12, 0	
8	XXZJJE	资金金额	N	17, 2	预留字段
9	XXSQRQ	申请日期	D	8	CCYYMMDD
10	XXSQSJ	申请时间	C	8	HHMMSSXX
11	XXSQLS	申请流水	C	10	
12	XXCXLS	撤销流水	C	10	
13	XXCXBZ	撤销标志	C	1	
14	XXJLLX	记录类型	C	2	预留字段
15	XXQSJL	起始记录	N	8, 0	预留字段
16	XXMXSL	明细数量	N	4, 0	预留字段
17	XXJLZS	记录总数	N	8, 0	预留字段
18	XXYWRQ	业务日期	D	8	预留字段
19	XXXYLS	响应流水	C	10	结算公司主机生成
20	XXXYRQ	响应日期	D	8	CCYYMMDD
21	XXXYSJ	响应时间	C	8	HHMMSSXX
22	XXXYDM	响应代码	C	3	
23	XXXYYY	响应信息	C	60	
24	XXCLBZ	处理标志	C	1	
25	XXTXXZ	通信小站	C	16	

26	XXBYZD	备用字段	C	50	预留字段
----	--------	------	---	----	------

(1) 通过本接口库，结算公司将新增优先标识指令响应、撤销优先标识指令响应、新增免除标识指令响应、撤销免除标识指令响应、新增待处置锁定指令响应、撤销待处置锁定指令响应等数据实时传送给结算参与人。

(2) XXGNDM 含义详见下表。

下行功能代码含义表

XXGNDM	交易代码含义	对应的申请交易	备注
7011	新增优先标识指令响应	7010, 单笔响应	响应结算参与人发出的新增优先标识指令
7111	撤销优先标识指令响应	7110, 单笔响应	响应结算参与人发出的撤销优先标识指令
7021	新增免除标识指令响应	7020, 单笔响应	响应结算参与人发出的新增免除标识指令
7121	撤销免除标识指令响应	7120, 单笔响应	响应结算参与人发出的撤销免除标识指令
7031	新增待处置锁定指令响应	7030, 单笔响应	响应结算参与人发出的新增待处置锁定指令
7131	撤销待处置锁定指令响应	7130, 单笔响应	响应结算参与人发出的撤销待处置锁定指令

(3) XXXYDM (响应代码) 为 ‘001’ 表示接收成功, 其余情况为校验失败, 相关错误信息可通过 XXXYXX (响应信息) 获取。

3.7 清算明细库 BJSXM1.DBF

BJSXM1.DBF 接口中 MXJSFS (字段 20: 交收方式) 字段取值 ‘A’ 的含义调整为 “担保净额 DVP 交收”。

3.8 综合数据服务库 BJSFW.DBF

(1) 上月交易量数据

北京分公司于每月第一个交易日日终, 通过 BJSFW 接口中数据类别为 ‘01’

的数据下发备付金账户对应的上月交易量数据(仅限于采用多边净额担保交收的证券品种), 具体填写说明如下:

序号	字段名	字段内容	类型	长度	填写说明
1	FWSJLB	数据类别	C	2	'01'
2	FWJSDM	结算账号	C	6	结算账号
3	FWMXZH	资金账户	C	10	备付金账号
4	FWXWDM	托管单元	C	6	托管单元
5	FWZQDM	证券代码	C	6	空格
6	FWGDDM	证券账户	C	10	对托管人结算备付金账户下每个托管产品的数据, 本字段为对应产品的证券账户; 其他情况本字段为空格。
7	FWMRJE	买入金额	N	16, 3	股票类买入总额
8	FWMCJE	卖出金额	N	16, 3	卖出总额
9	FWZJYE	资金余额	N	16, 3	债券现券类买入总额
10	FWCLRQ	处理日期	D		T日
11	FWFSRQ	发送日期	D		T日
12	FWZYSM	摘要说明	C	60	空格
13	FWBYBZ	备用标志	C	1	空格

说明: 对于申请开通了结算数据抄送业务的资产管理人, 结算系统将抄送明细到证券账户级别的成交量数据至管理人。

(2) 本月最低备付金比例及限额数据

北京分公司于每月第一个交易日日终, 通过BJSFW接口中数据类别为'03'的数据下发参与人本月最新的最低备付比例及限额数据, 具体填写说明如下:

序号	字段名	字段内容	类型	长度	填写说明
1	FWSJLB	数据类别	C	2	'03'
2	FWJSDM	结算账号	C	6	结算账号

3	FWMXZH	资金账户	C	10	备付金账号
4	FWXWDM	托管单元	C	6	空格
5	FWZQDM	证券代码	C	6	空格
6	FWGDDM	证券账户	C	10	空格
7	FWMRJE	买入金额	N	16, 3	股票类最低备付比例
8	FWMCJE	卖出金额	N	16, 3	债券现券类最低备付比例
9	FWZJYE	资金余额	N	16, 3	最低备付金限额
10	FWCLRQ	处理日期	D		生效日期 (T+5 日)
11	FWFSRQ	发送日期	D		发送日期 (T 日)
12	FWZYSM	摘要说明	C	60	空格
13	FWBYBZ	备用标志	C	1	最低备付比例类型, 取值如下: ‘1’ 表示差异化比例; ‘2’ 表示固定比例; 空格表示其它。

说明: (1) 资金余额字段是参与者最终的最低结算备付金限额, 于每月第六个交易日生效。(2) 对于申请开通了结算数据抄送业务的资产管理人, 结算系统将抄送上述数据, 抄送的数据中, 最低备付金限额填写为 0, 最低备付比例为对应托管人的比例, 仅供资产管理人参考。

四. 联系方式

技术咨询: 010-50939991

技术咨询邮箱: bfjs@chinaclear.com.cn