

关于发布深市股票期权结算数据接口规范 1.00z 版的通知

各证券公司、基金管理公司及相关单位：

为了配合深市股票期权项目行权的优化改造，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司对前期公布的《深市股票期权结算数据接口规范（结算参与人版）》（下面简称期权结算接口）和《深市登记结算数据接口规范涉及股票期权业务接口说明》（下面简称证券结算接口）进行了相应调整，请有意参与深市股票期权业务的参与人于 2015 年 6 月 7 日之前做好相关技术改造，中国结算深圳分公司将于 6 月择机组织有关参与人进行联网测试。

相对于 1.00e 版数据接口规范主要变化如下：

- (1) 期权结算接口 SQ_JSMX.DBF 中补充了做市商优惠数据的明细金额，在原有经手费返还金额基础上增加了成交奖励金额明细。
- (2) 期权结算接口 SQ_BZJ 中删除资金信息类别为' 05' 的数据和说明。本次业务方案修订后，E+1 日只可能因为买入 ETF 暂未完成成交收而锁定资金（资金信息类别为' 03'），而行权证券不足将会直接转现金清算（包含在资金信息类别' 10'）。
- (3) 期权结算接口中删除 SQ_HYZH 文件，合约账户的信息由 UAP 提供。
- (4) 证券结算接口 SJSJG.DBF 中增加 ETF 认沽期权申报行权证券锁定的数据。

(5) 证券结算接口里删除了 FJYBS 与 FJYQR 文件中合约账户开立与注销业务相关的接口数据，包括业务类别 P2(注册)、P3(注销)的数据。

《深市股票期权结算数据接口规范（结算参与者版）》和《深市登记结算数据接口规范涉及股票期权业务接口说明》可以在深交所网站（www.szse.cn）“新一代交易系统专栏”的“接口规范”栏目下载，也可以在深交所新一代交易系统 QQ 群文件下载。

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

2015 年 5 月 18 日