

深市登记结算数据接口规范涉及股票期权 业务接口说明

总体概述

深市登记结算系统中涉及股票期权业务的下发数据有：

1、 备兑开仓担保券锁定

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。每日发送日终锁定的全部担保券，启用新的业务类别'QQSD'，属“通知”类数据。

2、 期权行权标的券过户

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。发送日期为行权交收日，内容是行权交收的最终过户结果，启用新的业务类别'QQGH'，属“明细结果”类数据。

3、 期权行权资金违约的待清偿证券扣划及待清偿证券返还

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。

对待清偿证券扣划，启用新的业务类别'QQDC'，属“明细结果”类数据；

对待清偿证券返还，启用新的业务类别'QQDH'，属“明细结果”类数据。

4、 ETF 期权行权付券方标的券交收锁定

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。

新增业务类别'QQXQ'，表示期权行权 E+1 日付券方已到帐份额中被锁定的部分，属“明细结果”类数据。

5、ETF 认沽期权申报行权证券锁定

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。

新增业务类别'QQSP'，表示申报行权的认沽期权锁定证券数据，属“明细结果”类数据。

增加此锁定类型后，冻结与交收锁定总股数公式改为：

$DJ00(\text{冻结与交收锁定总股数}) = FGSD(\text{交收锁定总股数}) + QQXQ(\text{行权锁定}) + QQSP(\text{ETF 认沽期权行权申报锁定}) + QQSD(\text{备兑担保券锁定}) + DJKS(\text{可售冻结总股数}) + \text{不可售冻结总股数}$ 。

6、ETF 期权标的券可用额度调整

通过对外接口 SJSFW.DBF 发送。启用新的数据类别表示标的券的可用额度调整。'P1'表示当日净买入及净申购的可用份额用于备兑开仓的部分（记减）；'P2'主要是两类数据的轧差结果：行权 E+1 日付券方当日净买入及净申购份额部分的锁定（记减）、行权 E+1 日收券方实收的可用额度（记增）；'P3'表示 E 日 ETF 认沽期权申报行权锁定的 ETF 份额。

7、 期权行权资金违约的转处置证券扣划及返还

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。

对转处置证券扣划，启用新的业务类别'QQZC'，属“明细结果”类数据；

对转处置证券返还，启用新的业务类别'QQZH'，属“明细结果”类数据。

对手方信息填在 JGTGDY2（托管单元 2）、JGFJSM（附加说明）中。业务流水号与期权接口证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF 中相应的业务类别'Q206'、'Q2047'的业务流水号一致。

8、 期权行权资金违约的垫券、还券扣划

通过对外接口 SJSJG.DBF 发送。

对垫券，启用新的业务类别'QQDQ'，属“明细结果”类数据；

对还券，启用新的业务类别'QQHQ'，属“明细结果”类数据。

对手方信息填在 JGTGDY2（托管单元 2）、JGFJSM（附加说明）中。业务流水号与期权接口证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF 中相应的业务类别'Q212'、'Q213'的业务流水号一致。

接口说明

1、 明细结果库 SJSJG.DBF

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	25	
3	JGSJLX	数据类型	C	2	
4	JGYWLB	业务类别	C	4	
5	JGZQDM	证券代码	C	8	
6	JGJYDY	交易单元	C	6	
7	JGTGDY	托管单元	C	6	
8	JGZQZH	证券账户号码	C	20	
9	JGDDBH	订单编号	C	24	
10	JGYYB	营业部代码	C	4	
11	JGZXBH	执行编号	C	16	
12	JGYWLSH	业务流水号	C	16	
13	JGCJSL	成交数量	N	15,2	
14	JGQSSL	清算数量	N	15,2	
15	JGJSSL	交收数量	N	15,2	
16	JGCJJG	成交价格	N	13,4	
17	JGQSJG	清算价格	N	18,9	
18	JGXYJY	信用交易标识	C	1	
19	JGPCBS	平仓标识	C	1	
20	JGZQLB	证券类别	C	2	
21	JGZQZL	证券子类	C	2	
22	JGGFXZ	股份性质	C	2	
23	JGJSFS	交收方式	C	1	
24	JGHBDH	货币代号	C	3	
25	JGQSBJ	清算本金	N	17,2	
26	JGYHS	印花税	N	12,2	
27	JGJYJSF	交易经手费	N	12,2	
28	JGJGGF	监管规费	N	12,2	
29	JGGHF	过户费	N	12,2	
30	JGJSF	结算费	N	12,2	
31	JGSXF	手续费	N	12,2	
32	JGQSYJ	券商佣金	N	12,2	券商系统自用
33	JGQTFY	其它费用	N	12,2	
34	JGZJJE	资金金额	N	17,2	
35	JGSFJE	收付净额	N	18,2	

36	JGJSBZ	交收标志	C	1	
37	JGJGDM	结果代码	C	4	
38	JGCJRQ	成交日期	C	8	CCYYMMDD
39	JGQSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
40	JGJSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
41	JGFSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
42	JGQTRQ	其它日期	C	8	CCYYMMDD
43	JGSCDM	市场代码	C	2	
44	JGJYFS	交易方式	C	2	
45	JGZQDM2	证券代码 2	C	8	
46	JGTGDY2	托管单元 2	C	6	
47	JGFJSM	附加说明	C	100	
48	JGBYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

(1) 本库用于向结算参与人发送各类明细结果，内含 SJSMXn.DBF 中非担保类清算明细的逐笔交收结果（要参见具体业务定义）、担保类业务交收违约待处置结果以及登记存管类股份和资金明细。券商可根据自身需要，根据明细结果进行相关交收和记账处理。

(2) JGSJLX（字段 3：数据类型），‘01’：明细结果；‘02’：通知类数据。

(3) JGJSSL(字段 15：交收数量)，实际交收的股份数量，正数表示结算参与人收到的数量；负数表示结算参与人付出的数量。全部交收成功时等于 JGQSSL。

(4) JGSFJE（字段 35：收付净额），一般情况下 $JGSFJE = JGQSBJ + JGYHS + JGJYF + JGJGGF + JGGHF + JGJSF + JGSXF + JGQTFY + JGZJJE$ ，特殊情况参见具体业务定义。

(5) JGJSBZ(字段 36：交收标志)，‘Y’：交收成功；‘N’：交收失败。

(6) JGJGDM(字段 37：结果代码)，若交收标志 JGJSBZ=‘Y’且 JGJGDM 不为空，则表示变更原因代码；若 JGJSBZ=‘N’且 JGJGDM 不为空，则表示错误代号，具体代码定义请参考 SJSGB.DBF 中 GBLB=‘ZY’的数据定义或参见《深圳证券交易所数据接口规范》中错误代码含义表（表 6-4）。

(7) 其它各字段含义参照 SJSMXn.DBF 中“字段描述”相同的字段。

SJSJG.DBF业务类别表（仅列示本次调整有关）

新接口业务类别	业务类别含义	业务大类
QQSD	期权备兑开仓担保券锁定	期权业务
QQGH	期权行权标的券过户	

QQDC	期权行权资金交收违约的待清偿证券	
QQDH	期权行权资金交收违约的待清偿证券还券	
QQXQ	期权行权E+1日付券方已到帐份额中被锁定的部分	
QQZC	期权行权资金违约的转处置证券扣划	
QQZH	期权行权资金违约的转处置证券返还	
QQDQ	期权行权资金违约的垫券	
QQHQ	期权行权资金违约的还券	
QQSP	ETF认沽期权申报行权证券锁定	

A:

字段名	业务类别				
	QQSD(期权备兑开仓担保券锁定)	QQGH(期权行权标的券过户)	QQDC(期权行权资金交收违约的待清偿证券扣划)	QQDH(期权行权资金交收违约的待清偿证券返还)	QQSP(ETF认沽期权申报行权证券锁定)
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'02'	'01'	'01'	'01'	'02'
JGYWLB	'QQSD'	'QQGH'	'QQDC'	'QQDH'	'QQSP'
JGZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
JGJYDY					
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码
JGDDBH					
JGYYB					
JGZXBH					
JGYWLSH			业务流水号	业务流水号	
JGCJSL					
JGQSSL					
JGJSSL	锁定数量	<0 付券方股东记录, >0 收券方股东记录	待清偿证券扣划数量, 负数	待清偿证券还券数量, 正数	锁定数量

JGCJJG					
JGQSJG					
JGXYJY					
JGPCBS					
JGZQLB					
JGZQZL					
JGGFXZ					
JGJSFS					
JGHBDH					
JGQSBJ					
JGYHS					
JGJYJSF					
JGJGGF					
JGGHF					
JGJSF					
JGSXF					
JGQSYJ					
JGQTFY					
JGZJJE					
JGSFJE					
JGJSBZ		‘Y’	‘Y’	‘Y’	
JGJGDM					
JGCJRQ					
JGQSRQ	T 日	股票： T-1 日 ETF： T-2 日	T 日	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ					
JGSCDM					
JGJYFS					
JGZQDM2					
JGTGDY2					
JGFJSM					
JGBYBZ					

B:

字段名	业务类别				
	QQXQ (期权)	QQZC (期)	QQZH (期)	QQDQ	QQHQ(期)

	行权 E+1 日付券方已到帐份额中被锁定的部分)	权行权资金违约的转处置证券扣划)	权行权资金违约的转处置证券返还)	(期权行权资金违约的垫券)	权行权资金违约的还券)
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'02'	'01'	'01'	'01'	'01'
JGYWLB	'QQXQ'	'QQZC'	'QQZH'	'QQDQ'	'QQHQ'
JGZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
JGJYDY					
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码	证券账户号码
JGDDBH					
JGYYB					
JGZXBH					
JGYWLSH		业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
JGCJSL					
JGQSSL					
JGJSSL	锁定数量	转处置扣划证券数量, 负数表示划出, 正数表示划入	转处置返还证券数量, 负数表示划出, 正数表示划入	垫券数量, 负数表示划出, 正数表示划入	还券数量, 负数表示划出, 正数表示划入
JGCJJG					
JGQSJG					
JGXJYJ					
JGPCBS					
JGZQLB					
JGZQZL					
JGGFXZ					
JGJSFS					
JGHBDH					
JGQSBJ					
JGYHS					
JGJYJSF					
JGJGGF					
JGGHF					
JGJSF					
JGSXF					

JGQSYJ					
JGQTFY					
JGZJJE					
JGSFJE					
JGJSBZ		‘Y’	‘Y’	‘Y’	‘Y’
JGJGDM					
JGCJRQ					
JGQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ					
JGSCDM					
JGJYFS					
JGZQDM2					
JGTGDY2		对手方托管单元	对手方托管单元	对手方托管单元	对手方托管单元
JGFJSM		对手方证券账户	对手方证券账户	对手方证券账户	对手方证券账户
JGBYBZ					

2、 综合数据服务库 SJSFW.dbf

序号	字段名	字段内容	类型	长度	备注
1	FWSJLB	数据类别	C	2	
2	FWJSDM	结算席位代码	C	6	
3	FWMXZH	资金账户	C	10	
4	FWXWDM	席位代码	C	6	
5	FWZQDM	证券代码	C	6	
6	FWGDDM	股东代码	C	10	
7	FWMRJE	买入金额	N	16,3	
8	FWMCJE	卖出金额	N	16,3	
9	FWZJYE	资金余额	N	16,3	
10	FWCLRQ	处理日期	D		
11	FWFSRQ	发送日期	D		
12	FWZYSM	摘要说明	C	60	
13	FWBYBZ	备用标志	C	1	

(1) FWSJLB (字段 1: 数据类别): 用于说明本条数据记录的内容, 如结算备付金调整成交量统计和最低结算备付金限额等, 并决定了记录中其他字

段的取值，详细定义见附表。

(2) FWJSDM (字段 2: 结算席位代码): 指参与人单位在结算公司用于资金法人结算的席位代码;

(3) FWMXZH (字段 3: 资金账户): 指参与人单位在结算公司开立的资金结算账户;

(4) FWXWDM (字段 4: 席位代码): 指参与人单位下属证券营业部席位代码 (托管单元);

(5) FWZQDM (字段 5: 发生证券代号): 该笔记录数据相关的证券代码, 空表示不涉及具体的证券代码。

(6) FWMRJE (字段 7: 买入金额)、FWMCJE (字段 8: 卖出金额) 和 FWZJYE (字段 9: 资金余额) 说明参见表一。

(7) FWCLRQ (字段 10: 处理日期): 结算公司处理该笔数据的日期。

说明: 增加数据类别 P1, ETF 期权备兑券可用额度调整; 增加数据类别 P2, ETF 期权标的券行权可用额度调整; 增加数据类别 P3, ETF 认沽期权行权申报锁定额度。

数据类别说明含义表 (表一)

FWSJLB 数据类别	数据类别含义说明	FWMXZH H 资金账户	FWXWDM M 席位代码	FWZQDM M 证券代码	FWGDD M 股东代码	FWMRJE E 买入金额	FWMCJE E 卖出金额	FWZJYE E 资金余额	FWZYS M 摘要说明
P1	ETF 期权备兑券可用额度调整	空	托管单元	证券代码	股东代码	可用额度调整数量。 (<0 表示记减)	0	0	空

P2	ETF 期权标的券行权可用额度调整	空	托管单元	证券代码	股东代码	可用额度调整数量。 (<0 表示记减, >0 表示记增)	0	0	空
P3	ETF 认沽期权行权申报锁定额度	空	托管单元	证券代码	股东代码	可用额度调整数量。 (<0 表示记减)	0	0	空