



工程技术标准

深市股票期权结算数据接口规范

(结算参与人版 V1.00ζ)



中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

二〇一五年五月

文档信息

文档名称		深市股票期权结算数据接口规范	
编制者		中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司技术开发部	
说明		用于股票期权结算参与人与中国结算深圳分公司的数据交换	
修订历史 (REVISION HISTORY)			
Rev	Ty pe	Date	Remarks
0.1	创建	2014/2/24	征求意见稿
0.2	修订	2014/4/3	补充字段
0.3	修订	2014/5/12	变动类型细分到平昨和平今
0.4	修订	2014/5/21	1. 资金变动库中删除“备不足转非备兑仓”和“垫息”的业务类别。前者没有实体资金的变动，后者不收保证金不足的垫息了。 2. 调整了持仓变动库中的变动类别，增加一个“净持仓处理”的类别。
0.5	修订	2014/6/4	衍生品保证金库中的 20 数据改为在“清算交收日前一日”发送。统一叫法，保持与业务一致，如业务类别中“‘Q005’=罚金”的名称改为“‘Q005’=违约金”；“非备兑仓”统一叫“普通仓”等。
0.6	修订	2014/6/11	1. 期权行权的过户费在期权系统收取，于是接口中增加过户费字段。修改的数据库包括：SQ_JSMX、SQ_ZJBD、SQ_ZQJE。 2. 按业务定义，调整合约账户的顺序，证券账户+合约标识码。 2014/6/13，修订形成 1.00 a 版。

0.7	修订	2014/7/28	<ol style="list-style-type: none"> 1. SQ_JSMX 中增加“结算账号字段”。 2. SQ_ZQJE 中增加备兑券的锁定数据，业务类别为‘Q103’。 3. SQ_ZQJE 中增加结算账号字段。 4. SQ_ZJJE 中增加结算账号字段。 5. SQ_BZJ 中删除资金信息类别为‘20’的数据，改为体现于通知文件。 6. 对 SQ_BZJ 中数据进行符号说明。 7. SQ_BZJ 中增加结算账号字段。 8. SQ_ZJBD 中增加结算账号字段。 9. SQ_TZWJ 中增加通知类型为‘T101’和‘T102’的数据，调整了两个金额字段的填写。 10. SQ_ZJBD 中增加业务类别为‘Q104’的数据。 11. SQ_JSMX 中增加做市商交易经手费优惠的业务类别‘Q104’。 12. SQ_JSMX 中删除业务类别为‘Q301’的数据。 13. 备用字段统一改为 40 位的备用字符。 14. SQ_HYCB 中增加交易单元、结算账号字段，持仓是到交易单元的。 15. SQ_HYCC 中增加结算账号字段。 16. SQ_HYCB 中删除业务类别字段。 17. SQ_HYZH 中新增两个标志，增加每日申请结果的返还。 18. 日期字段改为 C8。
0.8	修订	2014/8/12	<p>把接口说明文档合并到接口规范文档中。</p> <p>2014/8/19，修订形成 1.00 β 版。</p>

0.9	修订	2014/10/10	<ol style="list-style-type: none"> 1. SQ_ZQJE 的行权过户费与行权证券交收结果合并到一条记录中。 2. SQ_ZJJE 中数据说明里填写结算账号字段。 3. SQ_ZQJE 中数据说明里 Q103 业务类别的数据, ZJJE 字段不填数值。 4. SQ_ZQJE 中增加业务为 Q207 的数据, 待处置券返还。 5. SQ_ZQJE 数据说明中业务类别为 Q202 和 Q203 的清算数量、交收数量字段填写内容做了调整。 6. SQ_BZJ 中数据说明作了修整, 资金信息类别'10'数据每日发送。 7. 接口文件名称增加月份和日期信息。 8. SQ_ZJBD 中对方账户字段改为 25 位。 9. SQ_TZWJ 中增加金额 1 和数量 1 字段的填写内容说明。 10. SQ_JSMX 中增加交易所成交申报编号、订单所有者类型和成交时间三个字段, 并对数据说明进行调整。 11. SQ_HYZH 数据说明里增加账户状态为'10'失效的数据。 <p>2014/10/10, 修订形成 1.00 γ 版。</p>
0.91	修订	2015/1/30	<ol style="list-style-type: none"> 1. SQ_HYZH 数据说明里增加摘要代号的说明。 2. SQ_BZJ 中增加资金信息类别为'05'的数据。 3. 把 SQ_JSMX 的 SSBH 字段名改为 SDDH。 4. SQ_JSMX 数据说明中行权指派数据中的交易经手费字段为 0, 增加了衍生品申报失败通知的数据类型及说明。 5. SQ_ZJJE 中数据说明里增加结算费字段。 6. SQ_ZJBD 删除业务类别为 'Q004' 调息的内容, 合并到 'Q003' 结息中。 7. SQ_TZWJ 中通知类别 'T001' 修改文字说明为“强平通知”。 8. SQ_ZQJE 中增加转处置、待清偿、垫券交收的接口数据说明。 9. SQ_ZJBD 中增加 'Q112' 待清偿资金返还的数据说明。 <p>2015/1/30, 修订形成 1.00 δ 版。</p>

0.92	修订	2015/4/17	<ol style="list-style-type: none"> 1. 修改 SQ_ZQJE 里待清偿证券扣划及返还业务的数据说明。 2. SQ_JSMX 里增加业务类别为'Q005'的违约金逐笔清算明细数据, 修改业务类别为'Q104'交易经手费优惠明细数据的说明。 3. SQ_TZWJ 里增加通知类型为'T104'的 ETF 行权应收应付资金额度调整数据。 4. 增加第四章说明。 <p>2015/4/17, 形成 1.00 ε 修订版。</p>
0.93	修订	2015/5/15	<ol style="list-style-type: none"> 1. SQ_ZJBD 中金额字段增加做市商优惠数据的返还。 2. SQ_BZJ 中删除资金信息类别为'05'的数据和说明。 3. 删除 SQ_HYZH 文件, 合约账户的信息由 UAP 提供。 <p>2015/5/25, 形成 1.00 ζ 修订版</p>

目 录

第一章	说明	1
第二章	接口文件说明	1
第三章	数据接口定义	2
1.	衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF	2
2.	衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF	10
3.	衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF	10
4.	衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF	11
5.	衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF	13
6.	资金净额交收库 SQ_ZJE.DBF	15
7.	证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF	16
8.	通知文件 SQ_TZWJ.DBF	22
第四章	数据申报查看指引	24

深市股票期权结算数据接口规范

第一章 说明

本文档用于描述中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称中国结算深圳分公司）在深市期权业务中对结算参与人的结算数据接口。

中国结算深圳分公司负责对本数据接口进行修订、解释。

第二章 接口文件说明

每日日终后，中国结算深圳分公司向结算参与人发送接口文件，接口名后带四位日期信息(两位月份两位日期)，例如 2014 年 5 月 1 日发送的 SQ_JSMX.DBF，参与人接收到的文件名为 SQ_JSMX0501.DBF。

- 1) 衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF
- 2) 衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF
- 3) 衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF
- 4) 衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF
- 5) 衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF
- 6) 资金净额交收库 SQ_ZJJE.DBF
- 7) 证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF
- 8) 通知文件 SQ_TZWJ.DBF

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。

1. 衍生品结算明细库 SQ_JSMX.DBF

文件内容：

1. 交易清算。
2. 行权指派。
3. 备兑券不足转普通仓。
4. 交易经手费每日优惠明细（仅对做市商）。
5. 通过交易通道申报业务的失败通知。
6. 违约金清算数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	'01'=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	'01'=衍生品清算数据 '04'=衍生品申报失败通知
3	YWLB	业务类别	C	4	'Q101'=期权交易 'Q102'=备兑券不足转普通仓 'Q104'=交易经手费优惠（含返还和奖励） 'Q201'=期权行权 'Q005'=违约金清算 'Q206'=转处置券扣划 'Q207'=转处置券归还 'Q208'=待清偿扣划客户 'Q209'=待清偿扣划自营 'Q212'=垫券 'Q213'=还券
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	DDBH	客户订单编号，	C	10	
6	SDDH	交易所订单编号	C	16	
7	ZXBH	执行编号	C	16	
8	DDSYLX	订单所有者类型	N	4, 0	
9	YWLSH	业务流水号	C	16	
10	ZQZH	证券账户号	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格

		码			
11	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
12	JYDY	交易单元	C	6	
13	JSZH	结算账号	C	6	
14	BZZH	资金账户	C	25	
15	HBDH	货币代号	C	3	
16	HYBM	合约编码	C	8	
17	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格
18	MMFX	买卖方向	C	1	
19	KPBZ	开平仓标志	C	1	
20	BDBZ	备兑标志	C	1	
21	CJSL	成交数量	N	15, 2	指合约数量
22	QSSL	清算数量	N	15, 2	
23	JSSL	交收数量	N	15, 2	
24	BDSL	标的数量	N	15, 2	
25	CJG	成交价格	N	13, 4	
26	QSJG	清算价格	N	18, 9	
27	BYJG	备用价格	N	18, 9	
28	QSZJ	清算资金	N	17, 2	正数表示参与者应收，负数表示参与者应付
29	JYJSF	交易经手费	N	17, 2	
30	GHF	过户费	N	17, 2	
31	JSF	结算费	N	17, 2	
32	QTJE1	其他金额 1	N	17, 2	
33	QTJE2	其他金额 2	N	17, 2	
34	QTJE3	其他金额 3	N	17, 2	
35	QTJE4	其他金额 4	N	17, 2	
36	QTJE5	其他金额 5	N	17, 2	
37	SFJE	收付净额	N	17, 2	
38	JSBZ	交收标志	C	1	
39	CJRQ	成交日期	C	8	CCYYMMDD
40	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
41	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
42	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
43	ZYDH	摘要代号	C	3	
44	CJSJ	成交时间	C	9	HHMMSSsss
45	BYBZ	备用标志	C	1	
46	BYSL	备用数量	N	15, 2	
47	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与者。

(2) 收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5。

(3) DDBH 字段对应深交所的客户订单编号;SDDH 对应深交所的交易所订单编号;ZXBH 字段对应深交所的执行编号;DDSYLX 对应深交所的成交申报订单所有者类型。

(4) JSFS 字段的取值说明如下:‘Y’=净额担保交收。

(5) HBDH 字段的取值说明如下:‘RMB’=人民币。

(6) MFMX 字段的取值说明如下:‘B’=买;‘S’=卖。

(7) KPBZ 字段的取值说明如下:‘O’=开仓;‘C’=平仓。

(8) BDBZ 字段的取值说明如下:‘G’=普通仓;‘C’=备兑仓。

(9) 数据填写说明如下:

A.

序号	字段名	字段描述	交易清算	交易经手费每日优惠明细
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘01’=衍生品清算数据	‘01’=衍生品清算数据
3	YWLB	业务类别	‘Q101’=期权交易	‘Q104’=交易经手费优惠(含返还和奖励)
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
5	DDBH	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
6	SSBH	交易所成交申报编号	交易所成交申报编号	交易所成交申报编号
7	ZXBH	执行编号	执行编号	执行编号
8	DDSYLX	订单所有者类型	订单所有者类型	空
9	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	证券账号
11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码
12	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
15	HBDH	货币代号	‘RMB’	‘RMB’
16	HYBM	合约编码	合约编码	合约编码
17	BDDM	标的代码	标的证券代码	空

18	MMFX	买卖方向	'B'=买 'S'=卖	'B'=买 'S'=卖
19	KPBZ	开平仓标志	'O'=开仓 'C'=平仓	'O'=开仓 'C'=平仓
20	BDBZ	备兑标志	'G'=普通仓 'C'=备兑仓	'G'=普通仓 'C'=备兑仓
21	CJSL	成交数量	合约数量 (单位: 张, 正数)	合约数量 (单位: 张, 正 数)
22	QSSL	清算数量	清算数量	合约数量 (单位: 张, 正 数)
23	JSSL	交收数量	交收数量	0
24	BDSL	标的数量	标的券数量(单位: 股或份, 买入方为 0, 备兑开仓的卖出 方表示需交付的证 券数量)	0
25	CJG	成交价格	成交价格	成交价格
26	QSJG	清算价格	清算价格	清算价格
27	BYJG	备用价格	0	0
28	QSZJ	清算资金	权利金, 正数表示 应收, 负数表示应 付	交易经手费返还金额 (正 数)
29	JYJSF	交易经手费	交易经手费	0
30	GHF	过户费	0	0
31	JSF	结算费	结算费	0
32	QTJE1	其他金额 1	0	成交奖励金额 (正数)
33	QTJE2	其他金额 2	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资 金+交易经手费+ 过户费+结算费+ 其他金额 1+其他 金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其 他金额 5	收付净额=清算资金+交 易经手费+过户费+结算 费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5
38	JSBZ	交收标志	'Y'	空
39	CJRQ	成交日期	成交日期	成交日期
40	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期
41	JSRQ	交收日期	交收日期	空
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期

43	ZYDH	摘要代号	空	空
44	CJSJ	成交时间	成交时间	成交时间
45	BYBZ	备用标志	空	主动成交：‘0’ 被动成交：‘1’ 主动成交为流动性消耗者；被动成交为流动性提供者。
46	BYSL	备用数量	0	0
47	BYZF	备用字符	空	空

B.

序号	字段名	字段描述	备兑不足转普通仓	行权指派
1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘01’=衍生品清算数据	‘01’=衍生品清算数据
3	YWLB	业务类别	‘Q102’=备兑券不足转普通仓	‘Q201’=期权行权
4	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保交收	‘Y’=净额担保交收
5	DDBH	客户订单编号	空	空
6	SSBH	交易所成交申报编号	空	空
7	ZXBH	执行编号	空	空
8	DDSYLX	订单所有者类型	空	空
9	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	证券账号
11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	合约账户标识码
12	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	空	衍生品保证金账户
15	HBDH	货币代号	‘RMB’	‘RMB’
16	HYBM	合约编码	合约编码	合约编码
17	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码
18	MMFX	买卖方向	‘S’=卖	‘B’=买 ‘S’=卖
19	KPBZ	开平仓标志	‘O’=开仓	空
20	BDBZ	备兑标志	‘C’=备兑仓	‘G’=普通仓 ‘C’=备兑仓
21	CJSL	成交数量	开仓时提交备兑仓	行权指派合约数量（单

			的合约数量	位：张，负数)
22	QSSL	清算数量	合约数量	合约数量(单位：张，负数)
23	JSSL	交收数量	标的锁定成功的合约数量 (QSSL-JSSL=转普通仓的数量)	0
24	BDSL	标的数量	锁定标的券数量	标的券收付数量(正数表示应收，负数表示应付)
25	CJG	成交价格	0	行权价格
26	QSJG	清算价格	0	清算价格
27	BYJG	备用价格	0	0
28	QSZJ	清算资金	0	行权资金，正数表示应收，负数表示应付
29	JYJSF	交易经手费	0	0
30	GHF	过户费	0	0
31	JSF	结算费	0	结算费
32	QTJE1	其他金额 1	0	0
33	QTJE2	其他金额 2	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资金+交易经手费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5
38	JSBZ	交收标志	'Y'	空
39	CJRQ	成交日期	成交日期	行权申报日
40	QSRQ	清算日期	清算日期	行权清算日
41	JSRQ	交收日期	交收日期	行权交收日
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期
43	ZYDH	摘要代号	空	空
44	CJSJ	成交时间	空	空
45	BYBZ	备用标志	空	空
46	BYSL	备用数量	0	0
47	BYZF	备用字符	空	空

C.

序号	字段名	字段描述	行权申报失败	证券业务申报失败	违约金清算(月初第一天)
----	-----	------	--------	----------	--------------

1	SCDM	市场代码	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场	‘01’=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	‘04’=衍生品申报失败通知	‘04’=衍生品申报失败通知	‘01’=衍生品清算数据
3	YWLB	业务类别	‘Q201’=期权行权	‘Q206’=转处置券扣划 ‘Q207’=转处置券归还 ‘Q208’=待清偿扣划客户 ‘Q209’=待清偿扣划自营 ‘Q212’=垫券 ‘Q213’=还券	‘Q005’=违约金清算
4	JSFS	交收方式	空	空	‘Y’=净额担保交收
5	DDBH	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号	空
6	SSBH	交易所成交申报编号	交易所成交申报编号	交易所成交申报编号	空
7	ZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	空
8	DDSYLX	订单所有者类型	订单所有者类型	订单所有者类型	空
9	YWLSH	业务流水号	空	空	业务流水号
10	ZQZH	证券账户号码	证券账号	本方证券账号	空
11	ZHBS	合约账户标识码	合约账户标识码	空	空
12	JYDY	交易单元	交易单元	本方交易单元	空
13	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
14	BZZH	衍生品保证金账户	空	空	衍生品保证金账户
15	HBDH	货币代号	空	空	‘RMB’
16	HYBM	合约编码	合约编码	空	空
17	BDDM	标的代码	空	标的证券代码	空
18	MMFX	买卖方向	‘B’=买 ‘S’=卖	空	空
19	KPBZ	开平仓标志	空	空	空
20	BDBZ	备兑标志	空	空	空
21	CJSL	成交数量	申报数量	0	违约本金，正数
22	QSSL	清算数量	0	0	0
23	JSSL	交收数量	0	0	0
24	BDSL	标的数量	0	申报数量	0

25	CJG	成交价格	0	0	0
26	QSJG	清算价格	0	0	0
27	BYJG	备用价格	0	0	0
28	QSZJ	清算资金	0	0	违约金, 负数
29	JYJSF	交易经手费	0	0	0
30	GHF	过户费	0	0	0
31	JSF	结算费	0	0	0
32	QTJE1	其他金额 1	0	0	0
33	QTJE2	其他金额 2	0	0	0
34	QTJE3	其他金额 3	0	0	0
35	QTJE4	其他金额 4	0	0	0
36	QTJE5	其他金额 5	0	0	0
37	SFJE	收付净额	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5	收付净额=清算资金+交易经手费+过户费+结算费+其他金额 1+其他金额 2+其他金额 3+其他金额 4+其他金额 5
38	JSBZ	交收标志	空	空	空
39	CJRQ	成交日期	申报日期	申报日期	违约日期
40	QSRQ	清算日期			清算日期 (月初第一个工作日)
41	JSRQ	交收日期			交收日期 (月初第二个工作日)
42	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
43	ZYDH	摘要代号	‘001’=证券代码源有误 ‘002’=成交日期有误 ‘003’=证券代码有误 ‘004’=成交数量有误 ‘005’=交易单元有误	‘001’=证券代码源有误 ‘002’=成交日期有误或者非有效申报日期 ‘003’=证券代码有误 ‘004’=成交数量有误 ‘005’=交易单元有误 ‘006’=扩展交易单元有误 (划入待处置券的交易单元/垫券交易单元/用于扣划证券的交易单元) ‘007’=不存在扣划申报历史	空
44	CJSJ	成交时间	空	空	空
45	BYBZ	备用标志	空	空	空
46	BYSL	备用数量	0	0	0

47	BYZF	备用字符	空	扩展交易单元+‘ ’+ 扩展证券账户	空
----	------	------	---	-----------------------	---

2. 衍生品合约持仓库 SQ_HYCC.DBF

文件内容：

投资者期权合约的持仓数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
3	ZHBS	合约账户标识 码	C	6	
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	HYBM	合约编码	C	8	
7	CCFX	持仓方向	C	1	
8	BDBZ	备兑标志	C	1	
9	CCSL	持仓数量	N	15, 2	
10	WCBZJ	维持保证金	N	17, 2	
11	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
12	BYSL	备用数量	N	15, 2	
13	BYJE	备用金额	N	17, 2	
14	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。

(2) CCFX 字段的取值说明如下：‘L’=权利方；‘S’=义务方。

(3) BDBZ 字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

3. 衍生品合约持仓变动库 SQ_HYCB.DBF

文件内容：

投资者期权合约的当天持仓变动数据，按变动类型**汇总**。相关的标的证券变动数据通过现货系统的 SJSJG 文件发送。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	‘01’=深交所期权市场
2	ZQZH	证券账户 号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格

3	ZHBS	合约账户 标识码	C	6	结算账号
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	JSZH	结算账号	C	6	
6	HYBM	合约编码	C	8	
7	BDSL	变动数量	N	15, 2	
8	CCFX	持仓方向	C	1	
9	BDBZ	备兑标志	C	1	
10	BDLX	变动类型	C	3	‘C01’=期权开仓 ‘C02’=期权平昨仓 ‘C03’=期权平今仓 ‘C04’=期权未参与行权注销 ‘C05’=期权行权后注销 ‘C06’=备兑标的不足调整 ‘C07’=净持仓处理 ‘C08’=移仓
11	SLLX	数量类型	C	1	预留
12	BDRQ	变动日期	C	8	CCYYMMDD
13	BYSL	备用数量	N	15, 2	
14	BYZF	备用字符	C	40	

- (1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人。
- (2) CCFX 字段的取值说明如下：‘L’=权利方；‘S’=义务方。
- (3) BDBZ 字段的取值说明如下：‘G’=普通仓；‘C’=备兑仓。

4. 衍生品保证金库 SQ_BZJ.DBF

文件内容：

日终衍生品保证金账户状态以及账户相关资金数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	BZZH	衍生品保 证金账户	C	25	
2	JSZH	结算账号	C	6	
3	ZJXXLB	资金信息 类别	C	2	‘00’=账户余额 ‘01’=次一交易日可用余额 ‘02’=应交维持保证金 ‘03’=ETF 行权占用资金 ‘04’=最低结算准备金 ‘10’=ETF 行权应收应付资金额

					度 (ETF 行权在行权交收日提前调整的额度)
4	ZJJE	资金金额	N	17, 2	正数表示收入, 负数表示支出
5	HBDH	货币代号	C	3	
6	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
7	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与者。

(2) 一个衍生品保证金账户会有多条记录, 相同的资金信息类别只有一条记录。

(3) 金额字段是带符号的:

资金信息类别'02'/'04'都>0, 表示锁定的资金。

资金信息类别'03'>0, 表示 ETF 行权占用资金额度, 即 ETF 行权在途证券锁定资金, 次日现货系统资金足额的, 则释放'03'的资金。

资金信息类别'10'>0 时表示 ETF 行权净应收资金额度, <0 时表示 ETF 行权净应付资金额度, 该资金额度包括 ETF 行权证券不足转现金结算和行权结算费。

(4) 资金信息类别'02'是应锁定的资金金额, 并不是已经锁定的资金。

(5) 在发送数据当晚的通知文件中, 有如下关系: 当'00-02-03<04'时, 参与人要补足资金; 当'00-02-03<0'时是资金不足, 第二天有可能发生强行平仓。

(6) 在次一交易日交易所按'01'做开仓的前端监控, 有如下关系: '01=00-02-03+10'。

(7) 资金信息类别'10'只有在 ETF 行权交收日前一日才有有效数据, 平时为 0。在 ETF 行权交收日可用。

(8) SQ_BZJ.DBF 的数据说明如下:

序号	字段名	字段描述	日常	行权清算日 (E 日)	行权交收日 (E+1 日)	行权交收日 (E+2 日)
1.	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
2.	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
3.	ZJXXLB	资金信息类别	'00'= 账户余额 '01'= 次一交易日	'00'= 账户余额 '01'= 次一交易日可	'00'= 账户余额 '01'= 次一交易日可	'00'= 账户余额 '01'= 次一交易日可用

			可用余额 '02'= 应 交维持保 证金 '03'=ETF 行权占用 资金 '04'= 最 低结算准 备金	用余额 '02'= 应 交 维 持 保 证 金 '03'=ETF 行 权 占 用 资 金 '04'= 最 低 结 算 准 备 金	用余额 '02'= 应 交 维 持 保 证 金 '03'=ETF 行 权 占 用 资 金 '04'= 最 低 结 算 准 备 金 '10'=ETF 行 权 应 收 资 金 额 度	余额 '02'= 应 交 维 持 保 证 金 '03'=ETF 行 权 占 用 资 金 '04'= 最 低 结 算 准 备 金
4.	ZJJE	资金金额	资金金额	资金金额	资金金额	资金金额
5.	HBDH	货币代号	'RMB'	'RMB'	'RMB'	'RMB'
6.	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
7.	BYZF	备用字符	空	空	空	空

5. 衍生品资金变动库 SQ_ZJBD.DBF

文件内容：

当日资金变动数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZJZH	资金账户	C	25	衍生品保证金账户
2	JSZH	结算账号	C	6	
3	HBDH	货币代号	C	3	
4	YWLB	业务类别	C	4	'Q001'=出入金 'Q002'=调账 'Q003'=结息 'Q005'=违约金收取 'Q010'=直接扣款 'Q020'=预约提款 'Q101'=期权交易 'Q104'=交易经手费优惠（含返 还和奖励） 'Q201'=期权行权 'Q202'=行权证券违约转现金结 算 'Q203'=行权资金违约（价差保 证金划至待清偿账户）

					‘Q204’=ETF 行权占用资金划付 ‘Q211’=待清偿资金返还 ‘Q301’=合约调整零碎股(份额) 现金结算
5	ZJLSH	资金流水号	A	16	
6	SFJE	收付净额	N	17,2	
7	QSZJ	清算资金	N	17,2	正数表示应收, 负数表示应付
8	JYJSF	交易经手费	N	17,2	
9	GHF	过户费	N	17,2	
10	JSF	结算费	N	17,2	
11	QTJE1	其他金额 1	N	17,2	
12	QTJE2	其他金额 2	N	17,2	
13	QTJE3	其他金额 3	N	17,2	
14	QTJE4	其他金额 4	N	17,2	
15	QTJE5	其他金额 5	N	17,2	
16	TGDY	托管单元	C	6	备用
17	CPLB	产品类别	C	2	
18	DFZH	资金账户 2	C	25	
19	JZRQ	记账日期	C	8	CCYYMMDD
20	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
21	BZXX	备注信息	C	20	
22	BYBZ	备用标志	C	1	券商系统自用

说明信息:

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人,用于资金账户变更的事后对账。

(2) 业务类别表示每笔资金变动的含义。

(3) 交收数据的每笔记账,是“业务类别”粒度,包含本金和税费,不再提供税费流水数据。

(4) 金额字段都是带符号的。季度结息数据(业务类别=‘Q003’) 在每季度结息日(如遇节假日,则为节假日的前一工作日)才有数据内容,其他日期无该业务数据。结息时结息账户填在资金账户 2DFZH 字段,该字段暂时只用于该业务。

(5) 期权行权‘Q201’的数据会有两笔,一笔是行权净应收应付数据,一笔是行权证券过户的过户费数据。

(6) 业务类别为‘Q104’=交易经手费优惠(含返还和奖励)时,清算资金字段表示“总返还金额”,其他金额 1 表示“总奖励金额”。

6. 资金净额交收库 SQ_ZJJE.DBF

文件内容：

资金交收清算汇总数据和交收结果，汇总到衍生品保证金账户级别，按结算账号和交收日期汇总。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	'01'=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	'02'=衍生品业务清算汇总 '03'=衍生品业务交收结果
3	YWLB	业务类别	C	4	'Q201'=期权行权
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	YWLSH	业务流水号	C	16	
6	JYDY	交易单元	C	6	
7	JSZH	结算账号	C	6	
8	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
9	HBDH	货币代号	C	3	
10	ZJJE	资金金额	N	17,2	
11	JSF	结算费	N	17,2	
12	QTJE	其他金额	N	17,2	备用
13	SFJE	收付净额	N	17,2	
14	WYJE	违约金额	N	17,2	
15	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD
16	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
17	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
18	BYSL	备用数量	N	15,2	
19	BYZF	备用字符	C	40	

说明信息：

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人，用于资金交收的通知和对账。

(2) 数据类型为'02'时，收付净额=资金金额+结算费+其他金额。

(3) JSFS 字段的取值说明如下：'Y'=净额担保交收。

(4) SQ_ZJJE.DBF 的数据说明如下：

序号	字段名	字段描述	期权行权资金净额交收通知 (衍生品保证金账户汇总)	期权行权资金净额交收通知 (交易单元汇总)	期权行权资金净额交收结果
1.	SCDM	市场代码	'01'=深交所期权市场	'01'=深交所期权市场	'01'=深交所期权市场
2.	SJLX	数据类型	'02'=衍生品业务清算汇总	'02'=衍生品业务清算汇总	'03'=衍生品业务交收结果
3.	YWLB	业务类别	'Q201'=期权行权	'Q201'=期权行权	'Q201'=期权行权
4.	JSFS	交收方式	'Y'=净额担保交收	'Y'=净额担保交收	'Y'=净额担保交收
5.	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6.	JYDY	交易单元	空	交易单元	空
7.	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8.	BZZH	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户	衍生品保证金账户
9.	HBDH	货币代号	'RMB'	'RMB'	'RMB'
10.	ZJJE	资金金额	行权交收净应收付金额	行权交收净应收付金额	行权交收原净应收付金额
11.	JSF	结算费	结算费	结算费	结算费
12.	QTJE	其他金额	0	0	0
13.	SFJE	收付净额	收付净额=资金金额+结算费+其他金额	收付净额=资金金额+结算费+其他金额	行权交收实际收付金额
14.	WYJE	违约金额	0	0	违约金额
15.	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
16.	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
17.	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
18.	BYSL	备用数量	0	0	0
19.	BYZF	备用字符	空	空	空

7. 证券净额交收库 SQ_ZQJE.DBF

文件内容:

1. 证券交收的清算汇总和交收结果,按标的证券汇总到投资者级别。
2. 转处置券、待清偿券、垫券交收业务的成功处理结果。

具体数据包括:

1. 期权行权证券净额清算汇总和交收成功结果,包括行权标的过户费。

2. 行权交收失败违约应收券的锁定通知、行权证券交收失败转现金结算。
3. 备兑券的锁定数据。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	'01'=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	'02'=衍生品业务清算汇总 '03'=衍生品业务交收结果
3	YWLB	业务类别	C	4	'Q103'=备兑券锁定 'Q201'=期权行权 'Q202'=行权证券违约转现金结算 'Q203'=行权资金违约待清偿扣划 'Q206'=转处置券扣划 'Q207'=转处置券归还 'Q208'=申报待清偿扣划客户 'Q209'=申报待清偿扣划自营 'Q210'=待清偿证券返还 'Q212'=垫券 'Q213'=还券
4	JSFS	交收方式	C	1	
5	YWLSH	业务流水号	C	16	
6	JYDY	交易单元	C	6	
7	JSZH	结算账号	C	6	
8	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
9	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
10	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格
11	QSSL	清算数量	N	15,2	
12	JSSL	交收数量	N	15,2	
13	BZZH	衍生品保证金账户	C	25	
14	HBDH	货币代号	C	3	
15	ZJJE	资金金额	N	17,2	
16	GHF	过户费	N	17,2	
17	QTJE	其他金额	N	17,2	
18	SFJE	收付净额	N	17,2	
19	QSRQ	清算日期	C	8	CCYYMMDD

20	JSRQ	交收日期	C	8	CCYYMMDD
21	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
22	BYSL	备用数量	N	15, 2	
23	BYZF	备用字符	C	40	

说明信息:

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日日终发给结算参与人,用于证券交收的通知和对账。

(2) 若证券交收部分成功,剩余部分转现金结算,则 E 日的一笔交收通知对应 E+1/E+2 日的业务类别为'Q201'和'Q202'的交收结果各一笔。

(3) 一笔净交收有可能结果是一部分交收成功,一部分转现金结算一条业务交收通知的数据,可能会对应两笔交收结果。

(4) 收付净额=资金金额+过户费+其他金额。

(5) 业务类别 Q206、Q207 对应深交所申报的转处置扣券、还券业务;业务类别 Q208、Q209 对应深交所申报的待清偿扣划客户申报、待清偿扣划自营申报;业务类别 Q212、Q213 对应深交所申报的垫券、还券业务。

(6) 参与人行权资金违约,先按申报扣划客户或自营净应收券,体现于业务类别 Q208、Q209,若申报处理后未能覆盖交收违约金额,则按结算公司的约定算法自行扣划证券,体现于业务类别 Q203。

(7) JSFS 字段的取值说明如下:'Y'=净额担保交收。

(8) SQ_ZQJE.DBF 的数据说明如下:

A.

序号	字段名	字段描述	期权行权证券净额汇总	期权行权证券净额交收成功结果	期权行权证券不足转现金结算
1.	SCDM	市场代码	'01'=深交所期权市场	'01'=深交所期权市场	'01'=深交所期权市场
2.	SJLX	数据类型	'02'=衍生品业务清算汇总	'03'=衍生品业务交收结果	'03'=衍生品业务交收结果
3.	YWLB	业务类别	'Q201'=期权行权	'Q201'=期权行权	'Q202'=行权证券违约转现金结算
4.	JSFS	交收方式	'Y'=净额担保交收	'Y'=净额担保交收	'Y'=净额担保交收

5.	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6.	JYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
7.	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8.	ZQZH	证券账户号 码	证券账号	证券账号	证券账号
9.	ZHBS	合约账户标 识码	结算账号	结算账号	结算账号
10.	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代 码	标的证券代 码
11.	QSSL	清算数量	行权应收应付 证券数量	行权应收应 付证券数量	行权应收应 付证券数量
12.	JSSL	交收数量	0	实际交收的 证券数量	转现金结算 的证券股数
13.	BZZH	衍生品保证 金账户	空	空	衍生品保证 金账户
14.	HBDH	货币代号	空	空	‘RMB’
15.	ZJJE	资金金额	0	0	转现金结算 的金额
16.	GHF	过户费	过户费	过户费	0
17.	QTJE	其他金额	0	0	0
18.	SFJE	收付净额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额
19.	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20.	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21.	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22.	BYSL	备用数量	0	0	0
23.	BYZF	备用字符	空	空	空

B.

序号	字段名	字段描述	期权行权交收 失败违约应收 券锁定通知 (转处置)	期权行权申报 转处置券扣券 还券	备兑证券的 锁定情况
1.	SCDM	市场代码	‘01’=深交所 期权市场	‘01’=深交所 期权市场	‘01’=深交所 期权市场
2.	SJLX	数据类型	‘03’=衍生品 业务交收结果	‘03’=衍生品 业务交收结果	‘03’=衍生品 业务交收结 果
3.	YWLB	业务类别	‘Q203’=行权 资金违约(违	‘Q206’=转处 置券扣划	‘Q103’=备兑 券锁定

			约应收券锁 (定)	‘Q207’= 转处 置券归还	
4.	JSFS	交收方式	‘Y’=净额担保 交收	‘Y’=净额担保 交收	‘Y’=净额担 保交收
5.	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6.	JYDY	交易单元	交易单元	申报的本方交 易单元	交易单元
7.	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8.	ZQZH	证券账户号 码	证券账号	申报的本方证 券账号	证券账号
9.	ZHBS	合约账户标 识码	空	空	结算账号
10.	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代 码
11.	QSSL	清算数量	行权应收应付 证券数量	0	应锁定证券 数量 (正数)
12.	JSSL	交收数量	待处置的证券 数量	返还的证券数 量	实际锁定证 券数量 (正 数)
13.	BZZH	衍生品保证 金账户	空	空	空
14.	HBDH	货币代号	空	空	空
15.	ZJJE	资金金额	0	0	0
16.	GHF	过户费	0	0	0
17.	QTJE	其他金额	0	0	0
18.	SFJE	收付净额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额	收付净额=资 金金额+过 户费+其他金额
19.	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20.	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21.	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22.	BYSL	备用数量	0	0	0
23.	BYZF	备用字符	空	交易单元+‘ ’ +处置扣券或 返回的对手方 账户	空

C.

序号	字段名	字段描述	期权行权申报 待清偿扣划证	待清偿证券返 还	垫券交收
----	-----	------	------------------	-------------	------

			券		
1.	SCDM	市场代码	'01'=深交所 期权市场	'01'=深交所 期权市场	'01'=深交所 期权市场
2.	SJLX	数据类型	'03'=衍生品 业务交收结果	'03'=衍生品 业务交收结果	'03'=衍生品 业务交收结 果
3.	YWLB	业务类别	'Q208'=待清 偿扣划客户 'Q209'=待清 偿扣划自营	'Q210'=待清 偿证券返还	'Q212'=垫券 'Q213'=还券
4.	JSFS	交收方式	'Y'=净额担保 交收	'Y'=净额担保 交收	'Y'=净额担 保交收
5.	YWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
6.	JYDY	交易单元	申报的本方交 易单元	交易单元	申报的本方 交易单元
7.	JSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
8.	ZQZH	证券账户号 码	申报的本方证 券账号	证券账号	申报的本方 证券账号
9.	ZHBS	合约账户标 识码	空	空	空
10.	BDDM	标的代码	标的证券代码	标的证券代码	标的证券代 码
11.	QSSL	清算数量	申报证券数量	0	申报证券数 量
12.	JSSL	交收数量	实际处理证券 数量	返还的证券数 量	实际处理证 券数量
13.	BZZH	衍生品保证 金账户	空	空	空
14.	HBDH	货币代号	空	空	空
15.	ZJJE	资金金额	0	0	0
16.	GHF	过户费	0	0	0
17.	QTJE	其他金额	0	0	0
18.	SFJE	收付净额	收付净额=资 金金额+过户 费+其他金额	收付净额=资 金金额+过户 费+其他金额	收付净额=资 金金额+过户 费+其他金额
19.	QSRQ	清算日期	清算日期	清算日期	清算日期
20.	JSRQ	交收日期	交收日期	交收日期	交收日期
21.	FSRQ	发送日期	发送日期	发送日期	发送日期
22.	BYSL	备用数量	0	0	0
23.	BYZF	备用字符	交易单元+' ' +扣券证券账	空	交易单元+ ' '+借券或

			户		还券的对手方证券账户
--	--	--	---	--	------------

8. 通知文件 SQ_TZWJ.DBF

文件内容：

1. 强平通知。
2. 合约调整导致锁定证券不足数据。
3. 被指派行权合约待释放保证金（行权交收日交收前先释放的资金）。
4. ETF 行权应收应付证券及资金额度调整(包括转现金结算及结算费)。

保证金不足通知有两种：

1. 衍生品保证金账户余额不足交收，即履约保证金不足，若不补足则次日强行平仓。
2. 衍生品保证金账户余额足够交收，但结算准备金余额不足，即剩余资金不足最低结算准备金，若不补足则不允许开新仓。

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	SCDM	市场代码	C	2	'01'=深交所期权市场
2	SJLX	数据类型	C	2	'03'=衍生品业务交收结果
3	TZLX	通知类型	C	4	'T001'=强平通知 'T002'=结算准备金余额不足 'T101'=锁定的担保证券不足 'T102'=被指派行权合约待释放保证金 'T103'=ETF 行权应收应付证券额度调整 'T104'=ETF 行权应收应付资金额度调整
4	JYDY	交易单元	C	6	
5	TGDY	托管单元	C	6	
6	ZQZH	证券账户号码	C	20	启用 10 位，左对齐，余位补空格
7	ZHBS	合约账户标识码	C	6	
8	HYBM	合约编码	C	8	
9	BDDM	标的代码	C	8	启用 6 位，左对齐，余位补空格

10	JSZH	结算账号	C	6	
11	BZZH	衍生品保证金 账户	C	25	
12	HBDH	货币代号	C	3	
13	JE1	金额 1	N	17, 2	1. 不足金额, 负数。补足该部分资金才不会被强平 (可用余额小于 0); 被指派行权合约待释放保证金。 2. ETF 资金额度调整, 正数表示记增, 负数表示记减。
14	JE2	金额 2	N	17, 2	不足金额, 负数。补足该部分资金才可以开仓 (小于最低结算准备金)。
15	SL1	数量 1	N	15, 2	锁定标的证券不足数据, 正数;ETF 额度调整数量, 正数表示记增, 负数表示记减。
16	SL2	数量 2	N	15, 2	
17	FSRQ	发送日期	C	8	CCYYMMDD
18	BYZF	备用字符	C	40	

(1) 本库由中国结算深圳分公司每日发送, 若文件为空, 则无通知数据。通知类型为'T001'和'T002'的数据是在结算参与者资金不足时发送的。

(2) 通知类型为'T101'的数据是在锁定的担保证券不足时发送的, 一般在发生合约调整时会有数据。若有数据, 该数据会在合约调整生效日前一日发送。

(3) 通知类型为'T102'的数据只有在行权交收日前一日才发送。在行权交收日, 用于行权交收前释放资金。

(4) 通知类型为'T103'、'T104'的数据只有 ETF 期权在行权交收日前一日才有数据。在行权交收日, 提前给投资者使用或扣减的 ETF 的额度。

(5) TGDY 字段只有在通知类型为'T101'/'T103'时填写。

(6) HBDH 字段的取值说明如下: 'RMB'=人民币。

第四章 数据申报查看指引

1. 行权申报、转处置申报、待清偿申报、垫券申报业务说明

处理日期	业务	申报通道	结果接收通道	数据处理结果	
				成功	失败
E 日	行权申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'01'、业务类别为'Q201'的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q201'的数据。
E+1 日	个股转处置申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q206'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为 QQZC 的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q206'的数据。
	个股待清偿申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q208'、'Q209'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQDC'的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q208'、'Q209'的数据。
	个股、ETF 垫券申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q212'的数据；	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q212'的数据。

				体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQDQ'的数据。	
E+2 日	ETF 转处置申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q206'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQZC'的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q206'的数据。
	ETF 待清偿申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q208'、'Q209'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQDC'的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q208'、'Q209'的数据。
每交易日	个股、ETF 转处置返还申报、还券申报	交易通道	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'01'、业务类别为'Q207'、'Q213'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQZH'、'QQHQ'的数据。	体现于 SQ_JSMX 中数据类型为'04'、业务类别为'Q207'、'Q213'的数据。

2. 行权结果

处理日期	业务	接收通道	数据处理结果
E 日	行权指派	D-COM	逐笔明细：体现于 SQ_JSMX 中数据类型为‘01’、业务类别为‘Q201’的数据； 资金数据：体现于 SQ_ZJJE 中数据类型为‘02’、业务类别为‘Q201’的数据； 证券数据：体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为‘02’、业务类别为‘Q201’的数据。
E+1 日	个股期权行权 交收成功	D-COM	资金数据：体现于 SQ_ZJJE 中数据类型为‘03’、业务类别为‘Q201’的数据； 证券数据及过户费：体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为‘03’、业务类别为‘Q201’的数据； 证券系统过户结果：体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为‘QQGH’的数据。
	个股期权行权 证券不足转现 金结算	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为‘03’、业务类别为‘Q202’的数据。
	个股期权行权 资金不足扣待 清偿证券（非申 报）	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为‘03’、业务类别为‘Q203’的数据。
	ETF 期权行权前 可用额度调整	D-COM	资金额度：体现于 SQ_ZJJE 中数据类型为‘02’、通知类型为‘T104’的数据；

			证券额度：体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'02'、通知类型为'T103'的数据；体现于证券系统 SJSFW 中数据类别为'P2'的数据。
E+2 日	ETF 期权行权交易成功	D-COM	资金数据：体现于 SQ_ZIJE 中数据类型为'03'、业务类别为'Q201'的数据； 证券数据及过户费：体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'03'、业务类别为'Q201'的数据； 证券系统过户结果：体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQGH'的数据。
	ETF 期权行权证券不足转现金结算	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'03'、业务类别为'Q202'的数据；
	ETF 期权行权资金不足扣待清偿证券（非申报）	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'03'、业务类别为'Q203'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQDC'的数据。
每交易日	个股、ETF 期权待清偿券返还	D-COM	体现于 SQ_ZQJE 中数据类型为'03'、业务类别为'Q210'的数据； 体现于证券系统 SJSJG 中业务类别为'QQDH'的数据。

3. 做市商交易经手费优惠数据

处理日期	业务	接收通道	数据处理结果
每交易日	做市商交易经	D-COM	体现于 SQ_JSMX 中数据类型

	手费优惠清算		为'01'、业务类别为'Q104'的数据。
交收日	做市商交易经 手费优惠返还	D-COM	体现于 SQ_ZIBD 中业务类别 为'Q104'的数据。