

编号: SZSE999999-TG23

密级: 公开发布



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

约定购回业务之  
券商技术系统变更指南  
(Ver1.10)



深圳证券交易所  
中国结算深圳分公司  
二〇一六年七月

## 关于本文档

文档名称		约定购回业务之券商技术系统变更指南	
说明			
修订历史			
日期	版本	操作	说明
2012-8-31	0.90	创建文档	征求意见稿
2012-9-18	1.00	修订文档	根据试点券商的反馈意见修订
2012-12-07	1.01	修订文档	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、对 SJSMX1.DBF 中 MXWTXH 字段填写规则加以说明。</li> <li>2、对 SJSJG.DBF 中委托序号字段的填写规则加以说明，并增加错误代号及原因的说明。</li> <li>3、将 YDGH0002_ccyymmdd.dbf 中 GHRZLL（字段 13：实际融资利率）的类型由 N(4,0) 修订为 N(9,4)。</li> </ol>
2016-7-31	1.10	修订文档	升级到新一代交易系统接口

## 目 录

一、	说明.....	1
二、	业务说明.....	1
2.1	交易流程.....	1
2.2	证券代码.....	2
2.3	交易单元.....	2
2.4	合格投资者.....	2
2.5	其他说明.....	2
三、	委托申报.....	2
3.1	Binary 接口委托申报.....	2
3.2	STEP 接口委托申报.....	5
3.3	委托申报样例.....	7
四、	交易数据回报.....	10
4.1	Binary 接口成交回报.....	10
4.2	STEP 接口成交回报.....	12
五、	清算和交收.....	14
六、	业务数据报送.....	15
七、	开展约定购回业务的券商系统注意事项.....	15
7.1	行情相关说明.....	15
7.2	委托相关说明.....	15
7.3	关于投资者委托服务渠道.....	15
7.4	关于券商柜台系统.....	16
八、	联系方式.....	17
附件一、	约定购回业务的交易数据接口修订说明.....	18
附件二、	约定购回业务的结算数据接口修订说明.....	19
1、	接口简要说明.....	19
2、	清算明细库 SJSMX1.DBF.....	19
3、	明细结果库 SJSJG.DBF.....	22
4、	资金清算汇总库 SJSQS.DBF.....	22
5、	约定购回投资者待购回证券额度余额及变更 (SJSFW.DBF).....	23
7、	其它信息.....	25
附件三、	约定购回业务数据报送指南.....	26
1、	业务要求说明.....	26
2、	技术要求说明.....	26
3、	约定购回合格投资者报告 YDGH0000_ccyymmdd.dbf.....	27

---

4、约定购回当日初始交易报告 YDGH0001_ccyymmdd.dbf.....	28
5、约定购回当日购回交易报告 YDGH0002_ccyymmdd.dbf.....	30
6、约定购回当日终止购回报告 YDGH0003_ccyymmdd.dbf.....	32
7、约定购回当日特殊交易报告 YDGH0004_ccyymmdd.dbf.....	33
8、约定购回客户违约处置报告 YDGH0005_ccyymmdd.dbf.....	34
9、约定购回待购回及盯市报告 YDGH0006_ccyymmdd.dbf.....	35

## 约定购回业务之券商技术系统变更指南

### 一、说明

为了证券公司在深圳证券交易所（以下简称“本所”）交易系统上更好地开展约定购回式证券交易（以下简称“约定购回”）业务，本所会同中国结算深圳分公司专门编制和发布本指南，供相关证券公司及其 IT 提供商参考。

本所改造系统的宗旨：从技术上保障证券市场安全运行，同时，尽量减少系统改造对证券公司带来的影响。

**特别提示：本指南仅包括本所提供的业务服务。如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应修订。**

### 二、业务说明

约定购回业务是指符合条件的客户以约定价格向托管其证券的证券公司卖出标的证券，并约定在未来某一日期由客户按照另一约定价格从证券公司购回标的证券，证券公司根据与客户签署的协议将待购回期间标的证券产生的相关孳息返还给客户的交易。

标的证券发生配股时，客户可向证券公司购回配股权证。在送转股、配股产生零碎股的情形下，客户可向证券公司购回相应零碎股。

#### 2.1 交易流程

(1) 客户进行每笔约定购回前，应当与证券公司以书面或电子方式签署本次交易的《交易协议书》，列明本次交易的初始交易和购回交易标的证券品种、数量、金额、购回交易日等要素；

(2) 证券公司按照规定格式提交初始交易委托；

(3) 深交所交易系统对初始交易进行成交确认，向证券公司发送成交回报，并将成交结果发送中国结算深圳分公司；

(4) 到期购回日或双方协商一致的购回日，证券公司按照规定格式提交购回交易委托；

(5) 深交所交易系统对购回交易进行成交确认，向证券公司发送成交回报，

并将成交结果发送中国结算深圳分公司；

(6) 中国结算深圳分公司依据深交所确认的成交结果为初始交易和购回交易提供相应的证券登记和资金划付等业务处理服务。

## 2.2 证券代码

标的证券由证券公司与客户协商确定：标的证券应当为深交所上市交易的股票（B 股除外）、基金和债券，且不为非流通股、限售流通股和个人持有的解除限售存量股等。

## 2.3 交易单元

初始交易和购回交易只能通过会员指定的专用交易单元申报。

## 2.4 合格投资者

证券公司应当按照业务规则建立客户资质审查制度，实施投资者适当性管理，并向交易所报备合格投资者。

## 2.5 其他说明

(1) 约定购回业务属于综合金融服务平台，交易时间为每个交易日的 9:15 至 11:30, 13:00 至 15:30。

(2) 购回交易日必须为合法日期。

(3) 申报金额应当大于等于零且最小变动单位为 0.01 元。

(4) 证券公司应当建立根据业务规则和自身风险承受能力控制业务规模，并实施股份、资金前端监控。

## 三、委托申报

约定购回业务采用成交申报处理方式，可以通过 Binary 交易数据接口、STEP 交易数据接口的方式申报初始交易、购回交易等委托。申报当日有效，一经申报不得撤销。

### 3.1 Binary 接口委托申报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=101003	
ApplID	应用标识	100: 约定购回

SubmittingPBUID	申报交易单元	约定购回专用交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码
SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102: 深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型	102: 会员发起
ClearingFirm	结算机构代码	01: 中国结算深圳分公司
TransactTime	委托时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息
TradeReportID	客户成交申报编号	客户订单编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报	0
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel	0
TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party report for matching, 协议配对	1
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用	全空格
LastPx	价格	0
LastQty	数量	标的证券数量
TrdType	成交申报业务类别	1011: 约定购回初始交易 1012: 约定购回提前购回 1013: 约定购回到期购回 1014: 约定购回延期购回
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	0
ConfirmID	约定号	全空格
Side	本方参与者买卖方向	2: 卖出
PBUID	本方交易单元	客户方交易单元 (券融出)
AccountID	本方证券账户	客户方证券账户 (券融出)
BranchID	本方营业部代码	客户方所在营业部识别码 (券融出)
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	证券公司专用账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格
CashOrderQty	现金金额	交易金额

MaturityDate	购回交易日	
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号	暂不启用，填全空格
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元	购回交易时，填写
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	购回交易时，填写
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期	购回交易时，填写

说明：

(1) SubmittingPBUID（申报交易单元）应当填写为证券公司约定购回专用交易单元。

(2) SecurityID（证券代码）即托管在中国结算深圳分公司的证券产品代码。

(3) 购回交易委托中的 MaturityDate（购回交易日）应当等于对应初始交易委托的购回交易日。

(4) 购回交易委托中的 OrigSubmittingPBUID（初始交易申报交易单元）、OrigTradeReportID（初始交易客户成交申报编号）、OrigTradeDate（初始交易成交申报日期），应当分别等于对应初始交易委托的 SubmittingPBUID（申报交易单元）、TradeReportID（客户成交申报编号）、申报日期（TransactTime 委托时间字段的日期部分）。

(5) 客户为机构投资者时，CounterpartyAccountID（对手方证券账户）必须填写为机构客户对应的证券公司专用证券账户；客户为个人投资者时，CounterpartyAccountID 必须填写为个人客户对应的证券公司专用证券账户。

(6) CashOrderQty（现金金额）字段值为 0 时，表示证券公司与客户之间的不涉及资金的特殊交易业务。客户向证券公司购回配股权证时，SecurityID 的值为配股权证代码 08xxxx，该配股权证代码可能已在交易系统挂牌，也可能未在交易系统挂牌，券商技术系统不能稽核返还证券代码在证券信息库是否存在，应当依据中国结算深圳分公司的登记托管数据做校验。

(7) 若证券公司同意客户的购回交易延期，则只需在延期后的实际购回日申报购回交易指令。



### 3.2 STEP 接口委托申报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE	
1180	ApplID	应用标识	100
571	TradeReportID	客户成交申报编号	同一交易单元一个交易日内申报的成交申报的客户成交申报编号不得重复
522	OwnerType	成交申报所有者类型	102: 会员发起
828	TrdType	成交申报业务类别	1011: 约定购回初始交易 1012: 约定购回提前购回 1013: 约定购回到期购回 1014: 约定购回延期购回
856	TradeReportType	成交申报类型 0= Submit, 提交成交申报	0
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报	0
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式 1=Two-Party Report, 成交报告 2=One-Party report for matching, 协议配对	1
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间
<b>组件&lt;Instrument&gt;</b>			
48	SecurityID	证券代码	标的证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
<b>组件结束</b>			
<b>组件&lt;RootParties&gt;</b>			
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	1: 初始交易 2: 购回交易
→	1117	RootPartyID	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源 C: 通用市场参与者标识
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色 1: 申报交易单元

	1117	RootPartyID	参与人代码	初始交易申报交易单元 (购回交易时, 填写)	
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	C: 通用市场参与者标识 (购回交易时, 填写)	
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	13: 初始交易申报交易单元 (购回交易时, 填写)	
<b>组件结束</b>					
<b>组件&lt;TrdCapRptSideGrp&gt;</b>					
552	NoSides		side 个数	2	
→	54	Side	买卖方向	2: 客户方 (券融出)	
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>				
	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	
	→	448	PartyID	参与人代码	客户方交易单元
		447	PartyIDSource	参与人代码源	C: 通用市场参与者标识
		452	PartyRole	参与人代码角色	1: 交易单元
		448	PartyID	参与人代码	客户方证券账户
		447	PartyIDSource	参与人代码源	5: 中国投资者编号
		452	PartyRole	参与人代码角色	5: 投资者证券账户
		448	PartyID	参与人代码	客户方客户所在营业部 识别码
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D: 自定义代码
		452	PartyRole	参与人代码角色	4001: 营业部代码
	<b>组件结束</b>				
	54	Side	买卖方向	1: 证券公司方	
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>				
	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	
	→	448	PartyID	参与人代码	证券公司专用账户
		447	PartyIDSource	参与人代码源	5: 中国投资者编号
		452	PartyRole	参与人代码角色	5: 投资者证券账户
	<b>组件结束</b>				
<b>组件结束</b>					
31	LastPx		成交价格	0	
32	LastQty		成交数量	交易数量	

152	CashOrderQty	金额	交易金额
541	MaturityDate	购回交易日	
10182	OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	购回交易时, 填写
1125	OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期	购回交易时, 填写

说明:

(1) 初始交易委托申报, 不需要填写 RootParties 的初始交易申报交易单元字段, 以及初始交易客户成交申报编号、初始交易成交申报申报日期字段。购回交易 (包括提前购回、到期购回、延期购回) 委托申报, 需填写 RootParties 的初始交易申报交易单元字段, 以及初始交易客户成交申报编号、初始交易成交申报申报日期字段。

(2) 其它字段取值参见 Binary 接口说明部分。

### 3.3 委托申报样例

证券公司 (008888 交易单元、0866666666 证券账户) 与客户 (006666 交易单元、0055555555 证券账户、A9 营业部) 在 20120822 日达成初始交易 (000001 证券 100000 股、500000 元), 双方约定在 20121231 日购回交易; 在 20121224 日, 证券公司同意客户延期到 20130531 日购回交易; 在 20130531 日, 客户实际执行购回交易 (530000 元); 在待购回交易期间, 标的证券派送红股 10000 股、现金 20000 元 (税后)。则证券公司技术系统需按下列格式申报初始交易和购回交易指令:

#### 3.3.1 初始交易申报样例

**表 3-1 委托申报 BINARY 消息示例**

域名	取值
MsgType	101003
ApplID	100
SubmittingPBUID	008888
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	01
TransactTime	20120822-14:42:13:555
UserInfo	全空格

TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	1
TradeReportRefID	全空格
LastPx	0.0000
LastQty	100000.00
TrdType	1011
TrdSubType	0
ConfirmID	全空格
Side	2
PBUID	006666
AccountID	0055555555
BranchID	A9
CounterpartyPBUID	全空格
CounterpartyAccountID	0866666666
CounterpartyBranchID	全空格
CashOrderQty	500000.0000
MaturityDate	20121231
OrigTradeID	全空格
OrigSubmittingPBUID	全空格
OrigTradeReportID	全空格
OrigTradeDate	0

STEP 消息如下：

1180=100<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>828=1011<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20120822-14:42:13:555<SOH>48=000001<SOH>22=102<SOH>1116=1<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=A9<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000<SOH>32=100000.00<SOH>152=500000.0000<SOH>541=20121231<SOH>

### 3.3.2 购回交易申报样例

表 3-2 委托申报 BINARY 消息示例

域名	取值
MsgType	101003
AppID	100
SubmittingPBUID	008888
SecurityID	000001
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	01
TransactTime	20130531-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeReportID	B0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	1
TradeReportRefID	全空格
LastPx	0.0000
LastQty	110000.00
TrdType	1014
TrdSubType	0
ConfirmID	全空格
Side	2
PBUID	006666
AccountID	0055555555
BranchID	A9
CounterpartyPBUID	全空格
CounterpartyAccountID	0866666666
CounterpartyBranchID	全空格
CashOrderQty	510000.0000
MaturityDate	20121231
OrigTradeID	全空格
OrigSubmittingPBUID	008888
OrigTradeReportID	A0000001
OrigTradeDate	20120822

STEP 消息如下:

1180=100<SOH>571=B0000001<SOH>522=102<SOH>828=1014<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20130531-14:42:13:555<SOH>48=000001<SOH>22=102<SOH>1116=2<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>

H>448=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=A9<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000<SOH>32=110000.00<SOH>152=510000.0000<SOH>541=20121231<SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20120822<SOH>

## 四、交易数据回报

对于约定购回业务的初始交易、购回交易的委托申报，不论委托检查是否合法，交易系统都将返回一笔成交申报响应的成交回报记录。券商技术系统应当使用接收到的成交回报记录完成股份前端监控、资金前端监控、委托查询、清算、交收等所有业务处理。

### 4.1 Binary 接口成交回报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=201004	
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	100: 约定购回
ReportingPBUID	回报交易单元	约定购回委托申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	约定购回委托申报交易单元
SecurityID	证券代码	约定购回委托申报对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	约定购回委托申报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	约定购回委托申报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	约定购回委托申报对应字段值
TransactTime	回报时间	成交回报时间
UserInfo	用户私有信息	约定购回委托申报对应字段值
TradeID	交易所成交申报编号	
TradeReportID	客户成交申报编号	约定购回委托申报对应

		字段值
TradeReportType	成交申报类型	约定购回委托申报对应 字段值
TradeReportTransType	成交申报事务类别	约定购回委托申报对应 字段值
TradeHandlingInstr	成交申报模式	约定购回委托申报对应 字段值
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	约定购回委托申报对应 字段值
TrdAckStatus	成交申报响应状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	成交申报状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代 码	
LastPx	价格	约定购回委托申报对应 字段值
LastQty	数量	约定购回委托申报对应 字段值
TrdType	成交申报业务类别	约定购回委托申报对应 字段值
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	约定购回委托申报对应 字段值
ConfirmID	约定号	约定购回委托申报对应 字段值
ExecID	执行编号	
Side	本方参与者买卖方向	约定购回委托申报对应 字段值
PBUID	本方交易单元	约定购回委托申报对应 字段值
AccountID	本方证券账户	约定购回委托申报对应 字段值
BranchID	本方营业部代码	约定购回委托申报对应 字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	约定购回委托申报对应 字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	约定购回委托申报对应 字段值

CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	约定购回委托申报对应字段值
CashOrderQty	现金金额	约定购回委托申报对应字段值
MaturityDate	购回交易日	约定购回委托申报对应字段值
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号	约定购回委托申报对应字段值
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元	约定购回委托申报对应字段值
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	约定购回委托申报对应字段值
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期	约定购回委托申报对应字段值

说明：

(1) 若委托检查合法，则成交申报响应中的 TrdAckStatus 字段值为 0，TrdRptStatus 字段值为 0，TradeReportRejectReason 字段值为 0；否则，成交申报响应中的 TrdAckStatus 字段值为 1，TrdRptStatus 字段值为 1，TradeReportRejectReason 字段值不为 0。

## 4.2 STEP 接口成交回报

Tag	域名	字段描述	字段取值
	MessageHeader	MsgType=AR	
10179	ReportIndex	回报记录号	
1180	ApplID	应用标识	100
1003	TradeID	交易所为成交申报分配的唯一 ID	
571	TradeReportID	客户成交申报编号	约定购回委托申报对应值
522	OwnerType	成交申报所有者类型	约定购回委托申报对应值
828	TrdType	成交申报业务类别	约定购回委托申报对应值
856	TradeReportType	成交申报类型	约定购回委托申报对



			应值
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	约定购回委托申报对 应值
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	约定购回委托申报对 应值
8912	TrdAckStatus	成交申报响应状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
939	TrdRptStatus	成交申报状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
751	TradeReportRejectReason	成交申报被拒绝原因代 码	
1328	RejectText	成交申报被拒绝原因说 明	
60	TransactTime	成交申报接收时间	成交回报时间
<b>组件&lt;Instrument&gt;</b>			
48	SecurityID	证券代码	约定购回委托申报对 应值
22	SecurityIDSource	证券代码源	约定购回委托申报对 应值
<b>组件结束</b>			
<b>组件&lt;RootParties&gt;</b>			
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	约定购回委托申报对 应值
→	1117	RootPartyID	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色
<b>组件结束</b>			
<b>组件&lt;TrdCapRptSideGrp&gt;</b>			
552	NoSides	side 个数	约定购回委托申报对 应值
→	54	Side	买卖方向
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>		

	453	NoPartyIDs		参与人代码个数	约定购回委托申报对 应值
	→	448	PartyID	参与人代码	约定购回委托申报对 应值
		447	PartyIDSource	参与人代码源	约定购回委托申报对 应值
		452	PartyRole	参与人代码角色	约定购回委托申报对 应值
	组件结束				
组件结束					
17	ExecID		执行编号		
31	LastPx		成交价格		约定购回委托申报对 应值
32	LastQty		成交数量		约定购回委托申报对 应值
152	CashOrderQty		金额		约定购回委托申报对 应值
541	MaturityDate		购回交易日		约定购回委托申报对 应值
1126	OrigTradeID		初始交易交易所成交申 报编号		全空格
10182	OrigTradeReportID		初始交易客户成交申报 编号		约定购回委托申报对 应值
1125	OrigTradeDate		初始交易成交申报申报 日期		约定购回委托申报对 应值

## 五、 清算和交收

针对深交所约定购回成交指令的不同情况，中国结算深圳分公司采用不同的清算交收方式：对于委托金额不为 0 的指令，采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式；对于委托金额为 0 指令，采用 T 日纯券过户交收方式（不涉及资金清算交收）。

中国结算深圳分公司将通过 D-COM 系统向相关结算参与人发送 SJSMX1.DBF 和 SJSJG.DBF 两个接口文件，分别表示约定购回业务的逐笔清算明细和交收结果。

引入 YDCS（初始交易）、YDC1（初始交易（纯券过户））、YDDQ（购回交易）、YDD1（购回交易（纯券过户））四类业务类别，具体请参见 SJSMX1.DBF、SJSJG.DBF、SJSQS.DBF 等接口定义；引入 YB（约定购回投资者待购回证券额度变

更，仅针对因送转股、配股或调账等非交易业务导致的变更)、YC(约定购回投资者待购回证券额度余额)两类数据类别，具体请参见 SJSFW.DBF 接口定义;终止购回、违约处置等股份特殊调账通过 SJSJG.DBF 中业务类别为 TZGF 的数据下发。

注意：

1. 对于采用 T 日纯券过户交收方式的，其交收结果 T 日即体现在 SJSJG.DBF 中；对于采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式的，其交收结果将在 T+1 日的 SJSJG.DBF 中体现，相关资金交收数据体现在 SJSZJ.DBF 及 SJSYE.DBF 中。

2. 约定购回投资者待购回证券额度余额和变更数据仅供相关结算参与人参考，不得作为清算依据。

关于以上数据接口更多具体内容请参见[附件二、约定购回业务的结算数据接口修订说明](#)。

## 六、 业务数据报送

为满足本所对约定购回业务监管的需要，开展约定购回业务的券商应当向深交所报送相关业务报表。约定购回业务报表的报送途径为“深交所会员业务专区---公文及报表上传--创新业务报表报送”栏目，需使用专用电子证书（与技术月报上传或会籍业务所使用的电子证书相同）登录会员业务专区。具体要求参见[附件三、约定购回业务数据报送指南](#)。

## 七、 开展约定购回业务的券商系统注意事项

### 7.1 行情相关说明

约定购回标的证券基本资料已在证券信息文件 securities.xml 挂牌，但标的证券发生配股等权益处理时客户向证券公司购回的配股权证等证券代码可能未在深交所交易系统挂牌；约定购回成交行情等信息不会反映到行情信息中。

### 7.2 委托相关说明

可以通过交易网关申报委托和接收成交。

### 7.3 关于投资者委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标投资者及业务风险属性，自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等投资者委托渠道（可选择一种或多种渠道）

中的相应前端系统，以支持约定购回业务的委托指令录入。

#### 7.4 关于券商柜台系统

##### ◇ 接收到合格投资者委托指令时的处理

所有申报的数量、价格或金额等要素必须符合本所约定购回式证券交易相关业务规则。

证券公司应当实施相应的投资者适当性管理，确保向深交所交易系统申报的证券账户均为合法、合规账户。未开通相关交易权限的投资者不得录入该类业务的委托，或券商技术系统拒绝未开通交易权限的投资者委托。

对于出券方（包括证券公司自己的指定证券账户），证券公司应当对其实施股份前端监控。接收到相关委托时，必须正确冻结相应数量的股份；接收到自动撤单回报时，应当记加对应数量的股份。

对于出资方（包括证券公司自己的指定资金账户），证券公司应当对其实施资金前端监控。接收到相关委托时，必须正确冻结相应数量的资金；接收到自动撤单回报时，应当记加对应数量的资金。

##### ◇ 申报委托

接受投资者约定购回业务的委托指令后，按照数据接口规范所约定的内容申报委托，但应确保客户成交申报编号在同一个交易单元不能重复，否则后送到交易系统的重单委托将被视为非法而直接丢弃。

##### ◇ 业务规模控制

证券公司应当根据业务规则、自身风险承受能力以及有权部门的审批额度，控制其业务规模，避免业务风险。

##### ◇ 约定购回专用证券账户不得用于证券交易

证券公司应当严格管理其约定购回专用证券账户不得用于证券交易。

##### ◇ 购回交易指令中的红股与红利返还

标的证券在待购回交易期间发生过红股或红利派送的，券商技术系统应当通过调整购回交易申报数量实现红股返还，通过调整购回交易金额实现红利返还。

通过调整购回金额实现红利返还时，券商可通过调整任何一笔或多笔购回交易金额实现返还，并在当日业务数据报送的购回交易报告中予以说明。如果需要返还的红利金额超过客户所有待购回交易金额的，则超过部分不再通过调整购回交

易金额实现返还，由会员通过其他途径返还，但应在当日业务数据报送的购回交易报告中予以说明。

#### ◇ 相关税费收取

对于申报指令中初始交易金额、购回交易金额为 0 时，不涉及资金清算交收，不收取相关税费，对于申报指令中初始交易金额、购回交易金额不为 0 时，比照现行大宗交易收费规定收取相关税费。

## 八、 联系方式

业务：0755-88668367（交易）

0755-25938030（结算）

技术：0755-88668679、88668196（交易）

Email: [ssegcb@szse.cn](mailto:ssegcb@szse.cn)

0755-25946080（结算）

Email: [szjsb@chinaclear.com.cn](mailto:szjsb@chinaclear.com.cn)

0755-88668192（业务数据报送）

## 附件一、约定购回业务的交易数据接口修订说明

(1) 交易主机自动撤单含义表中约定购回业务的自动撤单原因及其解释说明。

委托申报拒绝原因代码表

原因代码	原因简称	原因说明
20001	无效账户	客户方账户为未开户账户
20002	无效账户	客户方账户是一个无效账户（已注销、挂失等等）
20010	数量非法	委托数量不是数量单位的整数倍
20023	无效单元	客户方交易单元不存在
20025	无效单元	申报交易单元无约定购回的业务权限
20026	无效单元	客户方账户是信用账户，但客户方交易单元是非信用交易单元； 客户方账户是非信用账户，但客户方交易单元是信用交易单元
20027	无效单元	客户方账户是 QFII 账户，但客户方交易单元不是指定交易单元
20047	规模超限	总规模超限
20055	无效会员	会员无初始交易权限
20056	无效账户	证券公司账户非指定的约定购回业务的专用证券账户
20068	结算机构错	结算机构代码错误
20069	无效账户	客户方账户为受限账户
20070	无效账户	客户方账户为不合格账户
20099	重单	重单

## 附件二、约定购回业务的结算数据接口修订说明

### 1、接口简要说明

针对深交所约定购回成交指令的不同情况，中国结算深圳分公司采用不同的清算交收方式：对于委托金额不为 0 指令，采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式；对于委托金额为 0 指令，采用 T 日纯券过户交收方式（不涉及资金清算交收）。

中国结算深圳分公司将通过 D-COM 系统向相关结算参与人发送 SJSMX1.DBF 和 SJSJG.DBF 两个接口文件，分别表示约定购回业务的逐笔清算明细和交收结果。

引入 YDCS（初始交易）、YDC1（初始交易（纯券过户））、YDDQ（购回交易）、YDD1（购回交易（纯券过户））四类业务类别，具体请参见下文 SJSMX1.DBF、SJSJG.DBF、SJSQS.DBF 等接口中的定义；引入 YB（约定购回投资者待购回证券额度变更，仅针对因送转股、配股或调账等非交易业务导致的变更）、YC（约定购回投资者待购回证券额度余额）两类数据类别，具体请参见下文 SJSFW.DBF 接口定义；终止购回、违约处置等股份特殊调账通过 SJSJG.DBF 中业务类别为 TZGF 的数据下发。

注意：

（1）对于采用 T 日纯券过户交收方式的，其交收结果 T 日即体现在 SJSJG.DBF 中；对于采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式的，其交收结果将在 T+1 日的 SJSJG.DBF 中体现，相关资金交收数据体现在 SJSZJ.DBF 及 SJSYE.DBF 中。

（2）约定购回投资者待购回证券额度余额和变更数据仅供相关结算参与人参考，不得作为清算依据。

### 2、清算明细库 SJSMX1.DBF

SJSMX1.DBF 的具体结构及定义请参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》。

其中 MXYWLB（业务类别）引入 YDCS（初始交易）、YDC1（初始交易（纯券过户））、YDDQ（购回交易）、YDD1（购回交易（纯券过户））四类业务，请见下表：

### 业务类别含义表

业务类别	业务类别含义
YDCS	约定购回初始交易
YDC1	约定购回初始交易（纯券过户）
YDDQ	约定购回购回交易
YDD1	约定购回购回交易（纯券过户）

表中四类业务用于约定购回的初始交易和购回交易（包括客户向证券公司购回配股权证及零碎股等）。对于委托金额不为 0 指令（对应业务类别 YDCS、YDDQ）采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式，清算数据中同时涉及到证券和资金；对于委托金额为 0 指令（对应业务类别 YDC1、YDD1）采用 T 日纯券过户交收方式，清算数据中只涉及证券，不涉及资金。具体请参见下表中 SJSMX1.DBF 填写说明。

SJSMX1.DBF 的数据填写说明如下：

字段名	业务类别			
	YDCS（约定购回初始交易）	YDDQ（约定购回购回交易）	YDC1（约定购回初始交易 - 纯券过户）	YDD1（约定购回到期交易 - 纯券过户）
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'	'01'	'01'
MXYWLB	'YDCS'	'YDDQ'	'YDC1'	'YDD1'
MXZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号	订单编号	订单编号
MXYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量	成交数量	成交数量	成交数量



MXQSSL	清算数量	清算数量	清算数量	清算数量
MXCJJG				
MXQSJG				
MXXYJY				
MXPCBS				
MXZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别
MXZQZL	证券子类别	证券子类别	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	'00'	'00'	'00'	'00'
MXJSFS	'N'	'N'	'N'	'N'
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金	清算本金	0, 表示 T+0 纯券过户无 相关资金	0, 表示 T+0 纯券过户无 相关资金
MXYHS	印花税	印花税		
MXJYJSF	交易经手费	交易经手费		
MXJGGF	监管规费	监管规费		
MXGHF	过户费	过户费		
MXJSF	结算费	结算费		
MXSXF	手续费	手续费		
MXQSYJ	结算参与者佣金	结算参与者佣金		
MXQTFY	其他费用	其他费用		
MXZJJE	资金金额	资金金额		
MXSFJE	收付净额	收付净额		
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日
MXSCDM				
MXJYFS	'02'	'02'	'02'	'02'
MXZQDM2				
MXTGDY2				
MXDDBH2				
MXCWDH	错误代号	错误代号	错误代号	错误代号
MXPPHM				
MXFJSM		购回交易对 应的初始订		购回交易 对应的初

		单编号		始 订 单 编 号
MXBYBZ				

### 3、明细结果库 SJSJG.DBF

SJSJG.DBF 的具体结构及定义请参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》（网址：[www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn) 的“技术专区/深圳市场/数据接口规范”栏目）。

对于 SJSJG.DBF 中 YDCS、YDDQ 业务，采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式的，交收结果 T+1 日体现在 SJSJG.DBF 中；对于 SJSJG.DBF 中 YDC1、YDD1 业务，采用 T 日纯券过户交收方式的，交收结果 T 日体现在 SJSJG.DBF 中。

对于终止购回、违约处置等股份特殊调账数据通过 SJSJG.DBF 中业务类别为 TZGF 的数据下发。

T 日 SJSJG.DBF 中即含有对申报要素合法性检查不通过的申报指令的交收结果，JGZYDH 字段值为相应原因代码，JGJSSL 字段值为 0，JGQSSL 字段值为 0，JGJSBZ 字段值为 ‘N’。

注：错误原因代码的定义请参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》中错误代码含义汇编的定义。

### 4、资金清算汇总库 SJSQS.DBF

资金清算汇总库 SJSQS.DBF 接口中增加两类数据，如下：

QSYWLB	相应业务含义	说明
YDCS	约定购回业务初始交易清算	QSZQDM 为证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。 买入金额表示买入成交应付资金，卖出金额表示卖出成交应收资金。 对于托管约定购回专用证券账户的托管单元，只有买入记录，其卖出金额为 0；其他托管单元，只有卖出记录，其买入金额为 0。
YDDQ	约定购回业务购回交易清算	QSZQDM 为证券代码； 成交日期=清算日期，交收日期=清算日期+1。 买入金额表示买入成交应付资金，卖出金额表示卖出成交应收资金。

QSYWLB	相应业务含义	说明
		对于托管约定购回专用证券账户的托管单元，只有卖出记录，其买入金额为 0；其他托管单元，只有买入记录，其卖出金额为 0。

SJSQS.DBF 的具体结构请参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》。

### 5、约定购回投资者待购回证券额度余额及变更 (SJSFW.DBF)

参与约定购回的投资者待购回证券额度变更，其仅包含因送转股、配股或调账等非交易业务导致的待购回交易证券额度的变更数据，通过 SJSFW.DBF 下发以供相关结算参与人参考，不得作为清算依据。

每日日终中国结算深圳分公司对额度余额进行监控，若余额为负数，证券公司须于下一交易日进行回补处理。

SJSFW.DBF 结构请见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》，数据类别 YB、YC 分别表示约定购回投资者待购回证券额度变更数据、约定购回投资者待购回证券额度余额数据。

FWSJLB 数据类别	数据类别含 义说明	FWMXZH 资金账户	FWXWDM 席位代码	FWZQDM 证券代码	FWGDDM 股东代码	FWMRJE 买入金额	FWMCJE 卖出金额	FWZJYE 资金余额	FWZYSM 摘要说明
YB	约定购回投资者待购回证券额度变更	空格	托管单元(约定购回投资者股份托管席位)	证券代码	约定购回投资者证券账户	变更额度数量, >0 表示投资者待购回额度记增, <0 表示投资者待购回额度记减	0	0	左起第 1~6 位为证券公司约定购回专用席位;左起第 7~16 位为证券公司约定购回专用证券账户;左起第 17~19 位为变更原因代号。(具体代号定义请参考 SJSGB.DBF 中 GBLB='ZY' 的数据定义或下面的“变更代号含义表”。)
YC	约定购回投资者待购回证券额度余额	空格	托管单元(约定购回投资者股份托管席位)	证券代码	约定购回投资者证券账户	额度余额数量, <0 表示余额为负, 须进行回补处理	0	0	左起第 1~6 位为证券公司约定购回专用席位;左起第 7~16 位为证券公司约定购回专用证券账户。

变更原因代号含义表

变更原因	相应业务含义
A38	未认购权证删除
A40	送转股到账
A41	配股权证到帐
A55	特殊调账（如终止购回、违约处置等）

## 7、其它信息

(1) 《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》

请参见 [www.chinaclear.cn](http://www.chinaclear.cn) 的“技术专区/深圳市场/数据接口规范”栏目。

(2) 联系方式

Email: [szjsb@chinaclear.com.cn](mailto:szjsb@chinaclear.com.cn)

电话: 0755-25946080

## 附件三、约定购回业务数据报送指南

### 1、业务要求说明

为满足交易所对约定购回业务监管的需要，确保约定购回业务顺利开展，券商最迟应于下一个交易日（T+1）日早上 9:00 之前通过深交所会员网上业务专区向深交所报送 T 日约定购回相关业务数据文件。内容包括：约定购回合格投资者报告、约定购回当日初始交易报告、约定购回当日购回交易报告、约定购回当日终止购回报告、约定购回当日特殊交易报告、约定购回客户违约处置报告、约定购回待购回及盯市报告等数据文件。各类数据文件说明如下：

(1) 约定购回合格投资者报告：填报券商最近一次约定购回合格投资者名单报送以来的变动情况，包括新增、撤销或资料更新。

(2) 约定购回当日初始交易报告：填报券商 T 日通过交易系统发生的约定购回初始交易情况；

(3) 约定购回当日购回交易报告：填报券商 T 日通过交易系统系统发生的约定购回交易的情况；

(4) 约定购回当日终止购回报告：填报券商 T 日通过非交易方式终止约定购回的情况；

(5) 约定购回当日特殊交易报告：填报券商 T 日因返还配股权、返还零碎股、回补处理等特殊业务而产生的约定购回交易情况；

(6) 约定购回客户违约处置报告：填报券商 T 日之前尚未完成或 T 日完成的约定购回违约处置情况，不包含 T 日之前已完成的违约处置；

约定购回待购回及盯市报告：填报截止 T 日，券商所有尚未购回的约定购回初始交易及其履约保障情况。

### 2、技术要求说明

(1) 所有的数据文件采用 DBF 结构(同交易系统关于 DBF 文件的约定要求)；

(2) 对于数值型字段，如果含小数部分，则字段长度包含小数点位；对于字符型字段，如无特别说明，字段内容要求左对齐，不足字段长度，则右补空格；

(3) 数据文件名采用形如 XXXXXXXX\_CCYYMMDD.dbf 的命名规范, 其中, XXXXXXXX 表示业务数据标识; CCYY、MM、DD 对应 T 日日期的年、月、日; '.dbf' 为文件扩展名。例如: T 日日期为 '2012-8-10', 则对应报送的数据文件名如下:

数据文件	文件名称
约定购回合格投资者报告	YDGH0000_20120810.dbf
约定购回当日初始交易报告	YDGH0001_20120812.dbf
约定购回当日购回交易报告	YDGH0002_20120812.dbf
约定购回当日终止购回报告	YDGH0003_20120812.dbf
约定购回当日特殊交易报告	YDGH0004_20120812.dbf
约定购回客户违约处置报告	YDGH0005_20120812.dbf
约定购回待购回及盯市报告	YDGH0006_20120812.dbf

券商通过深交所会员业务专区的“公文及报表上传”报送约定购回业务数据文件, 要求一次性报送所有的约定购回业务数据文件 (7 个)。如果当日无业务发生, 也需报送对应的空文件 (仅结构, 空记录)。

### 3、约定购回合格投资者报告 YDGH0000\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	YWMC	业务名称	C	4	'YDGH' = 约定购回
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHMC	客户名称	C	128	
4	ZJLB	客户证件类型	C	1	'0' = 身份证 '1' = 营业执照 '9' = 其它证件
5	ZJHM	客户证件号码	C	40	
6	ZZDM	组织机构代码	C	9	对于机构投资者有效
7	KHLX	客户类型	C	1	'0' = 个人 '1' = 机构
8	ZLLB	业务指令类别	C	1	'N' = 新报送或更新 'C' = 撤销
9	QSRQ	风险认知书签署日期	C	8	格式: CCYYMMDD
10	KTRQ	交易权限开通日期	C	8	格式: CCYYMMDD
11	CXRQ	交易权限撤销日期	C	8	格式: CCYYMMDD
12	YBSB	营业部识别码	C	2	
13	SFHG	是否合格投资者	C	1	'0' = 不合格 '1' = 合格
14	BSFS	数据报送方式	C	1	'A' = 增量 'R' = 全量
15	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回合格投资者报告：券商最近一次约定购回合格投资者名单报送以来的变动情况（增量报送），包括新增、撤销或资料更新。

(1) YWMC（业务名称）：固定填写为‘YDGH’,表示约定购回的合格投资者报告。

(2) KHMC（客户名称）、ZJLB（客户证件类别）、ZJHM（客户证件号码）：应与证券账户资料一致，如果个人投资者提供的是身份证，则要求是 18 位的身份证号码。

(3) ZZDM（组织机构代码）：对于机构投资者有效，个人投资者设置为全空格。

(4) YWLB（业务指令类别）：‘N’表示首次报送该合格投资者的资料或对之前报送的投资者（同一客户证券账户号）的资料进行修改；‘C’（撤销）：撤销投资者（同一客户证券账户号）在券商处进行约定购回交易权限；对于已被券商撤销交易权限的投资者，后续不允许券商对其资料进行修改。

(5) QSRQ（风险认知书签署日期）：投资者与券商签订风险认知书的日期。

(6) KTRQ（交易权限开通日期）：允许投资者在券商处进行约定购回相关交易业务的开始日期。

(7) CXRQ（交易权限撤销日期）：撤销投资者在券商处进行约定购回相关交易业务权限的日期，对于‘撤销’的业务指令，本字段必须填报，对于尚未撤销交易权限的合格投资者，本字段设置为全空格。

(8) YBSB（营业部识别码）：固定设置为全空格。

(9) SFHG（是否合格投资者）：固定设置为‘1’，表示合格投资者。

(10) BSFS（数据报送方式）：固定为‘A’，表示采用增量数据报送方式。

#### 4、约定购回当日初始交易报告 YDGH0001\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQDM	证券代码	C	6	
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHLX	客户类型	C	1	‘0’=个人投资者 ‘1’=机构投资者
4	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	CSHTXH	初始合同序号	C	22	



序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
6	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
7	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
8	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
9	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股
10	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元
11	GHJYJE	预期购回交易金额	N	18,2	
12	HBGLJY	是否合并管理交易	C	1	'0'=否 '1'=是
13	YSHTXH	原初始交易合同序号	C	22	
14	ZJYTMS	资金用途描述	C	100	
15	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回当日初始交易报告券商 T 日通过交易系统发生的约定购回初始交易情况, 不含特殊初始交易业务。

(1) KHLX (客户类型): 客户的身份属性, 个人投资者设置为‘0’, 机构投资者设置为‘1’ (下同)。

(2) CSJYRQ (初始交易日期): 本约定购回初始交易发生的日期 (下同)。

(3) CSHTXH (初始合同序号): 本约定购回初始交易的委托合同序号 (下同)。

(4) CSGHQX (初始购回期限)、CSGHRQ (初始购回日期)、CSRZLL (初始融资利率): 约定购回初始交易时, 券商与客户达成的购回期限、购回日期、融资利率。初始购回期限是初始交易日起至初始购回日期之间的自然日数; 融资利率的计量单位为年化收益率%, 如初始融资利率为 5.0000%, 则初始融资利率字段填报数值应为 5.0000 (下同)。

(5) CSJYSL (初始交易数量): 交易系统确认的约定购回初始交易合同的交易数量, 对应“综合回报库 SJSZHHB.dbf”的 HBCJSL, 数值上应大于等于 0 (下同)。

(6) CSJYJE (初始交易金额): 交易系统确认的约定购回初始交易合同的交易金额, 对应“综合回报库 SJSZHHB.dbf”的 HBHBJE, 数值上应大于等于 0 (下同)。

(7) 预期购回交易金额: 本约定购回初始交易按约定的初始购回日期及初始融资利率购回时, 预期的购回交易金额。

(8) HBGLJY (是否合并管理交易): 对于由于合并管理需要而发起的约定购回初始交易, 设置为‘1’ (是), 否则设置为‘0’ (否)。注: 合并管理是指一笔约定购回初始交易 (称为: 原初始交易) 达成后, 后续由于保证金不足而需新发起一笔或

多笔初始交易（称为：后续初始交易）以维持保证金满足履约保障要求的业务管理过程。对合并管理的后续初始交易，HBGLJY（是否合并管理交易）设置为‘1’；其它的初始交易，HBGLJY（是否合并管理交易）均设置为‘0’（下同）。

(9) HBHTXH（原初始交易合同序号）：如果本约定购回初始交易是合并管理的后续初始交易，则设置为原初始交易的合同序号，否则设置为全空格。

(10) ZJYTMS（资金用途描述）：简要描述客户从本约定购回初始交易中获得资金的后续用途，不超过 50 个汉字长度，左对齐，不足右补空格。

## 5、约定购回当日购回交易报告 YDGH0002\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQDM	证券代码	C	6	
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHLX	客户类型	C	1	‘0’=个人 ‘1’=机构
4	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	CSHTXH	初始合同序号	C	22	
6	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
7	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
8	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
9	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	
10	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	
11	GHJYRQ	购回交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
12	GHHTXH	购回交易合同序号	C	22	
13	GHRZLL	实际融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
14	GHJYLX	购回交易类型	C	1	‘1’=提前购回 ‘2’=到期购回 ‘3’=延期购回
15	GHJYSL	购回交易数量	N	10,0	单位:股
16	GHJYJE	购回交易金额	N	18,2	单位:元
17	QYCLSL	权益处理数量	N	10,0	单位:股
18	QYCLJE	权益处理金额	N	18,2	单位:元
19	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段，全空格

约定购回当日购回交易报告：券商 T 日通过交易系统系统发生的约定购回购回交易的情况，不含特殊购回交易业务。

(1) GHJYRQ（购回交易日期）：本约定购回交易发生的日期。

(2) GHHTXH (购回交易合同序号): 本约定购回交易的委托合同序号。

(3) GHJYLX (购回交易类型): 根据实际购回交易日期与初始交易时约定的购回日期的先后关系, 设定为提前购回、到期购回、延期购回, 分别取值‘1’、‘2’、‘3’。其中, 提前购回表示实际购回交易日期小于初始交易时约定的购回日期; 到期购回表示实际购回交易日期等于初始交易时约定的购回日期; 延期购回表示实际购回交易日期大于初始交易时约定的购回日期。如果初始交易约定的购回日期为非交易日, 则取下一个交易日参与比较, 例如, 初始交易约定的购回日期为‘2011-12-31’, 则应取下一个交易日‘2012-01-02’日参与比较。

(4) GHRZLL (实际融资利率): 本约定购回交易时实际采用融资利率, 数量单位为百分比的年化收益率。

(5) GHJYSL (购回交易数量)、GHJYJE (购回交易金额): 本约定购回交易实际发生的购回交易数量及购回交易金额, 如有权益处理, 按处理后的实际数量和金额进行填报。客户在初始交易到购回交易期间因分红、派息等权益分派获得的股份和资金, 应在购回交易数量中计加获得的权益股份、购回交易金额中计减获得的权益资金。特别地, 对于合并管理的多笔购回交易, 券商可通过调整任何一笔或多笔购回交易金额实现返还权益资金返还。(下同)

● 例 1 (单笔购回):

约定购回初始交易的数量和金额分别为 10000 股和 100000 元, 待购回交易数量和金额分别为 10000 股和 110000 元, 客户在初始交易到购回交易期间因权益分派获得 1000 股份和 2000 元现金, 则实际发生的购回交易数量和购回交易金额应为 11000 股和 108000 元。

● 例 2 (合并管理多笔购回):

第一笔约定购回初始交易的数量和金额分别为 10000 股和 100000 元, 待购回交易数量和金额分别为 10000 股和 110000 元, 客户在该初始交易到购回交易期间因权益分派获得 1000 股份和 2000 元现金。

第二笔约定购回初始交易的数量和金额分别为 500 股和 10 元, 待购回交易数量和金额分别为 500 股和 20 元, 客户在该初始交易到购回交易期间因权益分派获得 50 股份和 100 元现金。

如果券商将投资者因权益分派获得的 2100 元现金, 在第一笔初始交易的购回

交易中予以调整，则：第一笔约定购回初始交易的购回交易数量、购回交易金额分别为 11000 股和 107900 元；第二笔约定购回初始交易的购回交易数量、购回交易金额分别为 550 股和 20 元。

(6) QYCLSL (权益处理数量)、QYCLJE (权益处理金额):本约定购回交易涉及的分红、派息等权益处理数量和金额。(下同)

例如，上述例 1 中，权益处理数量、权益处理数量分别为 1000 股和 2000 元。例 2 中，第一笔购回交易的权益处理数量、权益处理金额分别为 1000 股和 2100 元，第二笔购回交易的权益处理数量、权益处理金额分别为 50 股和 0 元。

(7) YWBYZD (业务备用字段): 如果需要返还的红利金额超过客户所有待购回交易金额，则超出的部分由券商通过其它途径返还，并在业务备用字段(YWBYZD)中予以说明。(下同)

例如，约定购回初始交易的数量和金额分别为 10000 股和 100000 元，待购回交易数量和金额分别为 10000 股和 110000 元，客户在初始交易到购回交易期间因权益分派获得 1000 股份和 120000 元现金，则实际发生的购回交易数量和购回交易金额分别 11000 股和 0 元,权益处理数量、权益处理数量分别为 1000 股和 110000 元，剩余 10000 元的红利券商通过其它途径返还给客户，在业务备用字段中予以说明，表述格式如下：“其它途径返还红利 10000.00 元”。

## 6、约定购回当日终止购回报告 YDGH0003\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	BSRQ	报送日期	C	8	格式:CCYYMMDD
2	ZQDM	证券代码	C	6	
3	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
4	KHLX	客户类型	C	1	'0'=个人 '1'=机构
5	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
6	CSHTXH	初始合同序号	C	22	
7	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
8	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
9	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
10	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股
11	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
12	ZZGHRQ	终止购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
13	ZZGHSL	终止购回数量	N	10,0	单位:股
14	ZZGHJE	终止购回金额	N	18,2	单位:元
15	QYCLSL	权益处理数量	N	10,0	单位:股
16	QYCLJE	权益处理金额	N	18,2	单位:元
17	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回终止购回报告: 券商 T 日向交易所申报的终止约定购回情况。

(1) ZZGHRQ (终止购回日期): 券商向交易所申报终止购回业务的日期。

(2) ZZGHSL (终止购回数量)、ZZJYJE (终止购回金额): 终止购回实际发生的购回数量及购回金额, 如有权益处理, 按处理后的实际数量和金额进行填报。

(3) QYCLSL (权益处理数量)、QYCLJE (权益处理金额): 终止购回涉及的权益处理数量和金额。

(4) YWBYZD (业务备用字段): 如果需要返还的红利金额超过客户所有待购回交易金额, 则超出的部分由券商通过其它途径返还, 并在业务备用字段 (YWBYZD) 中予以说明。

### 7、约定购回当日特殊交易报告 YDGH0004\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQDM	证券代码	C	6	
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHLX	客户类型	C	1	'0'=个人 '1'=机构
4	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	CSHTXH	初始合同序号	C	22	
6	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
7	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
8	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
9	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股
10	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元
11	TSJYRQ	特殊业务交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
12	TSHTXH	特殊业务合同序号	C	22	
13	TSYWLX	特殊业务类型	C	1	'1'=返还配股权 '2'=返还零碎股 '3'=回补处理 '9'=其它

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
14	TSJYMS	特殊业务描述	C	16	返还配股权 返还零碎股 回补处理
15	TSJYSL	特殊业务交易数量	N	10,0	单位:股
16	TSJYJE	特殊业务交易金额	N	18,2	单位:元
17	QZDM	权证代码	C	6	
18	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回特殊交易报告: 券商 T 日因为返还配股权、返还零碎股、回补处理等特殊业务所产生的约定购回交易情况。

(1) TSJYRQ (特殊业务交易日期): 本项特殊业务发生的日期。

(2) TSHTXH (特殊业务合同序号): 本项特殊业务的委托合同序号。

(3) TSYWLX (特殊业务类型)、TSJYMS (特殊业务描述): 本项特殊业务的类型, 目前有返还配股权、返还零碎股、回补处理等三类特殊业务, 分别取值‘1’, ‘2’, ‘3’, 对应特殊业务描述为‘返还配股权’、‘返还零碎股’、‘回补处理’, 如特殊业务上有扩展, 将另行约定。

(4) ZQDM (证券代码)、TSJYSL (特殊业务交易数量)、TSJYJE (特殊业务交易金额)、TSYWLX (特殊业务类型)、QZDM (权证代码):

特殊业务类型	证券代码	特殊业务交易数量	特殊业务交易金额	权证代码
返还配股权	标的证券代码	返还的配股权证数量	0	配股权证代码
返还零碎股	标的证券代码	返还的标的证券数量	0	全空格
回补处理	标的证券代码	回补的标的证券数量	0	全空格

## 8、约定购回客户违约处置报告 YDGH0005\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQDM	证券代码	C	6	
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHLX	客户类型	C	1	‘0’=个人 ‘1’=机构
4	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	CSHTXH	初始合同序号	C	22	
6	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
7	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
8	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
9	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
10	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元
11	QDYWCZ	是否已启动违约处置程序	C	1	'N'=否 'Y'=是
12	CZKZRQ	违约处置开始日期	C	8	格式:CCYYMMDD
13	WYCZWC	是否已完成违约处置	C	1	'N'=否 'Y'=是
14	WYCZSL	违约处置数量	N	10,0	单位:股
15	WYCZJE	违约处置所得金额	N	18,2	单位:元
16	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回客户违约处置报告：券商 T 日之前尚未完成或 T 日完成的约定购回违约处置情况，不包含 T 日之前已完成的违约处置。

(1) QDYWCZ (是否已启动违约处置程序)：'N'表示券商内部尚未启动违约处置程序，'Y'表示券商内部已启动违约处置程序。

(2) CZKSRQ (违约处置开始日期)：券商开始执行违约处置的日期，对于该笔违约的多次处置，填写第一笔处置的日期，如果尚未处置，则设置为全空格。

(3) WYCZWC (是否已完成违约处置)：'N'表示尚未完成该笔违约的处置；'Y'表示已完成该笔违约的处置。

(4) WYCZJE (违约处置数量)、YWCZJE (违约处置所得金额)：截止 T 日，该违约处置的累计违约处置数量及累计违约处置所得金额。

### 9、约定购回待购回及盯市报告 YDGH0006\_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
1	ZQDM	证券代码	C	6	
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHLX	客户类型	C	1	'0'=个人 '1'=机构
4	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	CSHTXH	初始合同序号	C	22	
6	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%
7	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天
8	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD
9	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股
10	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元
11	GHJYJE	预期购回交易金额	N	18,2	单位:元

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注
12	HBGLJY	是否合并管理交易	C	1	'0'=否 '1'=是
13	HBHTXH	合并管理对应初始合同序号	C	22	
14	LYBZBL	履约保障比例	N	9,4	单位:%
15	LYBZJB	履约保障级别	C	1	'0'=正常 '1'=警戒 '2'=触发
16	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

约定购回待购回及盯市报告:截止 T 日, 券商所有尚未购回的约定购回初始交易及其履约保障情况。

(1) LYBZBL (履约保障比例): 券商设定的客户履约保障比例, 单位:百分比; 例如, 券商设定的履约保障比例为 5%, 则履约保障比例字段填报时应为 5.0000。对于合并管理的原初始交易和后续初始交易, 履约保障比例应是原初始交易和后续初始交易的一篮子合同的履约保障要求, 原初始交易和后续初始交易的履约保障比例均设置为该值。

(2) LYJYZT (履约保障级别): 截止 T 日日期, 券商根据履约保障的要求, 对尚未购回的初始交易的履约保障能力进行评级, 分为正常、警戒、触发三个级别, 分别取值为:'0'、'1'、'2'。正常表示履约保障比例未达到警戒线; 警戒表示履约保障比例达到或低于警戒线, 未达到最低线; 触发表示履约保障比例达到或低于最低线。如果是合并管理的原初始交易和后续初始交易, 履约保障级别应是原初始交易和后续初始交易的一篮子合同的履约保障评价, 原初始交易和后续初始交易的履约保障级别均设置为该值。