

深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

报价回购业务之  
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

<b>文档名称</b>		报价回购业务之券商技术系统变更指南	
<b>说明</b>			
<b>修订历史</b>			
<b>日期</b>	<b>版本</b>	<b>操作</b>	<b>说明</b>
2012-11-15	0.90	创建文档	征求意见稿
2012-12-04	1.00	修订文档	根据试点券商的反馈意见修订
2016-07-31	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、	业务简介.....	1
2.1	交易流程.....	1
2.2	产品续做方式.....	2
2.3	证券代码.....	3
2.4	交易单元.....	3
2.5	合格投资者.....	3
2.6	其他说明.....	3
三、	交易指令申报.....	3
3.1	Binary 接口委托申报.....	4
3.2	STEP 接口委托申报.....	6
3.3	委托申报样例.....	8
四、	成交申报响应.....	10
4.1	Binary 接口成交申报响应.....	10
4.2	STEP 接口成交申报响应.....	12
五、	清算和交收.....	14
六、	业务数据报送.....	15
七、	开展报价回购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.....	15
八、	联系方式.....	16
附件一、	报价回购业务的交易数据接口修订说明.....	17
附件二、	报价回购业务的结算数据接口修订说明.....	18
1、	接口简要说明.....	18
2、	清算明细库 SJSMX1.DBF.....	18
3、	资金清算汇总库 SJSQS.DBF.....	22
4、	明细结果库 SJSJG.DBF.....	23
5、	资金变动库 SJSZJ.DBF.....	25
6、	非交易报送库 FJYBS.DBF 与非交易确认库 FJYQR.DBF.....	26
8、	综合服务库 SJSFW.DBF.....	26
9、	其它信息.....	26
附件三、	报价回购业务数据报送指南.....	28

---

1、业务要求说明 .....	28
2、技术要求说明 .....	28
3、报价回购合格投资者报告 BJHG0000_ccyymmdd.dbf .....	29
4、报价回购业务规模报告 BJHG0001_ccyymmdd.dbf .....	30

## 报价回购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质押式报价回购交易（以下简称“报价回购”）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：如果业务规则及业务方案有所变更，本文档将做相应变更。**

### 二、业务简介

报价回购业务是指证券公司将符合规定的自有资产作为质押物，以质押物折算后的标准券数量所对应金额作为融资的额度，通过报价方式向证券公司符合条件的客户融入资金，同时约定证券公司在回购到期时向客户返还融入资金、支付相应收益的交易。

#### 2.1 交易流程

- (1) 证券公司向客户发出报价；
- (2) 客户接受证券公司报价的，向证券公司发出初始交易委托；
- (3) 证券公司接受委托后申报初始交易指令；
- (4) 深交所交易系统对可用额度内的初始交易指令进行即时成交确认，向证券公司与中国结算深圳分公司即时发送成交回报；
- (5) 中国结算深圳分公司在到期购回日依据初始交易确认数据自动完成清算交收，证券公司无需申报到期购回交易指令；
- (6) 若客户选择到期自动续做，或选择到期手动续做且在规定时间内确认的，则证券公司应于到期购回日根据客户的真实意愿重新申报初始交易指令；若客户选择到期手动续做但未在规定时间内确认的，则证券公司无需向深交所交易系统申报指令；
- (7) 若客户选择提前购回，则证券公司应于提前购回日申报提前购回交易指

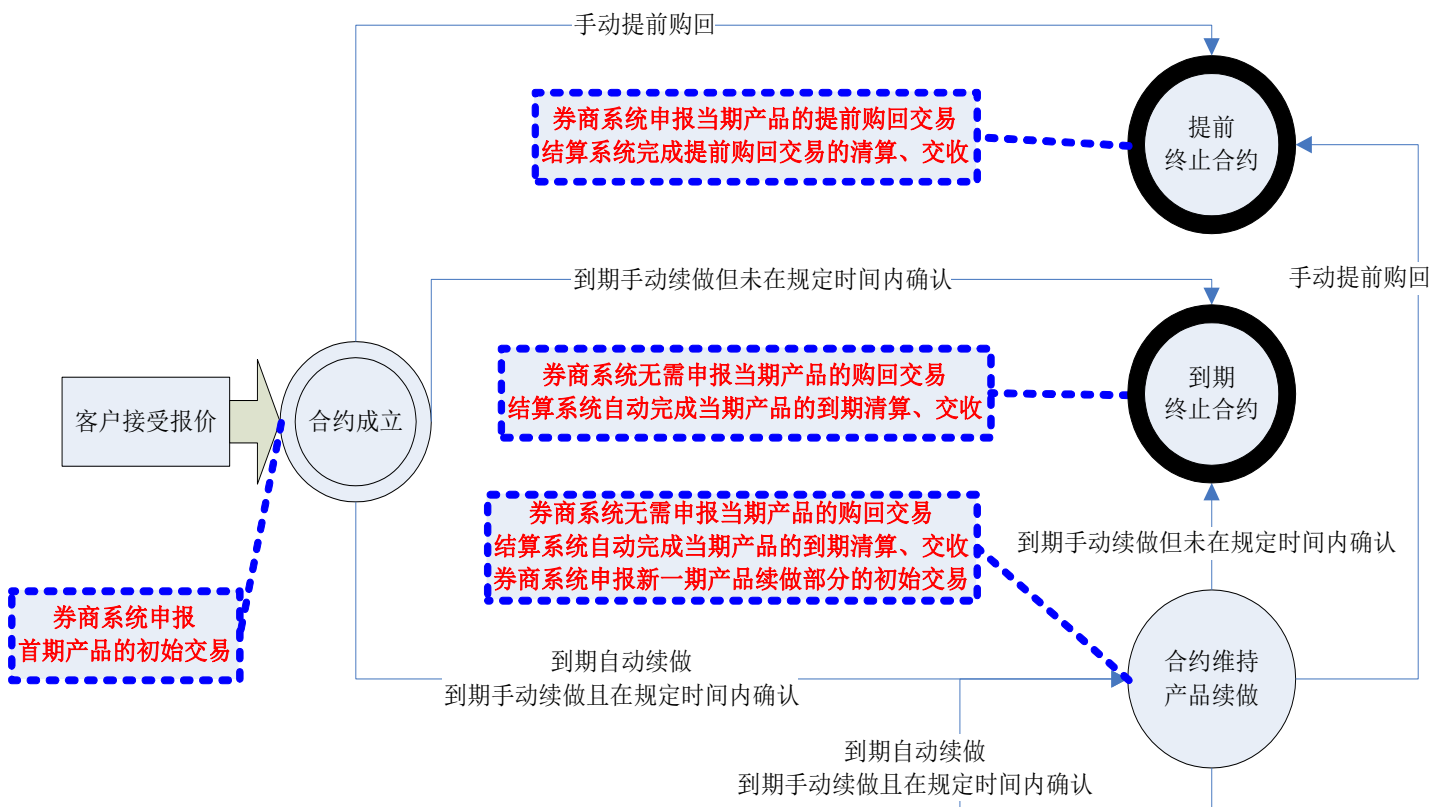
令；

(8) 深交所交易系统对提前购回交易指令进行即时成交确认，记加可用额度，向证券公司与中国结算深圳分公司即时发送成交回报。

(9) 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提前购回交易提供相应的质押登记和资金划付等业务处理服务。

## 2.2 产品续做方式

客户可以按照证券公司的业务方案选择具体的产品到期续做方式。



若客户选择到期自动续做，或选择到期手动续做且在规定时间内重新确认的，券商系统应维持与客户的合约，记载各产品的续做关系。券商系统在到期购回日无需申报当期产品的购回交易指令，结算系统将自动完成当期产品的到期清算、交收，但券商系统应在到期购回日申报新一期产品续做部分的初始交易指令。

若客户选择到期手动续做但未在规定时间内确认的，券商系统应在到期购回日终止与客户的合约。券商系统在到期购回日无需申报当期产品的购回交易指令，

结算系统将自动完成当期产品的到期清算、交收。

产品到期前，客户可以按照证券公司的业务方案将产品提前购回，券商系统应终止与客户的合约。在提前购回当日，券商系统应申报当期产品的提前购回交易指令，结算系统将依据提前购回交易指令完成相应的清算、交收。

### 2.3 证券代码

报价回购业务的交易证券代码为 1320xx，由本所负责分配。

证券公司通过 D-COM 系统将自有资产出入质押库，中国结算深圳分公司按业务规则将其折算为标准券。对于每张标准券，证券公司可以开展 100 元额度的报价回购初始交易。

### 2.4 交易单元

初始交易和提前购回交易只能通过会员指定的专用交易单元申报。

各会员只能申报自己证券公司报价回购产品的交易证券代码。

### 2.5 合格投资者

证券公司应当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。

### 2.6 其他说明

- (1) 交易时间为每个交易日的 9:15 至 11:30，13:00 至 15:30。
- (2) 交易品种的具体期限应符合规定，证券公司确定后需向本所报备。
- (3) 初始交易最低申报数量为 10 张，超出部分应为 10 张的整倍数；提前购回交易最低申报数量为 1 张，超出部分应为 1 张的整数倍。
- (4) 申报价格应大于零且最小变动单位为 0.001 元。
- (5) 深交所交易系统控制证券公司的报价回购总规模，不区分品种期限。
- (6) 初始交易确认成交的，当日可提前购回交易。
- (7) 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、交易指令申报

报价回购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委托。委托申报当日有效，一经申报不得撤销。

报价回购的成交申报委托处理流程参见《深圳证券交易所 Binary 交易数据接口规范》“3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)”一节或《深圳证券交易所 STEP 交易数据接口规范》“3.8.2 成交报告申报模式 (two party report)”一节。

### 3.1 Binary 接口委托申报

表 3-1 BINARY 接口成交申报消息定义

域名	字段描述	初始交易字段取值	提前购回字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=101103		
ApplID	应用标识	110=报价回购	110=报价回购
SubmittingPBUID	申报交易单元	报价回购指定交易单元	报价回购指定交易单元
SecurityID	证券代码	证券代码	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	102=深圳证券交易所
OwnerType	订单所有者类型	102=会员发起	102=会员发起
ClearingFirm	结算机构代码	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	委托时间	委托申报时间	委托申报时间
UserInfo	用户私有信息	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	客户订单编号
TradeReportType	成交申报类型 0=提交成交申报	0	0
TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New 1=Cancel	0	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	1
TradeReportRefID	原客户成交申报编号 撤销成交申报时使用	全空格	全空格
LastPx	价格	初始交易申报价格	提前购回申报价格
LastQty	数量	初始交易申报数量	提前购回申报数量
TrdType	成交申报业务类别	1021=报价回购初始交易	1022=报价回购提前购回
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	0	0
ConfirmID	约定号	全空格	全空格
Side	本方参与者买卖方向	1=买入	1=买入



PBUID	本方交易单元	客户交易单元 (资金融出)	客户交易单元 (资金融出)
AccountID	本方证券账户	客户证券账户 (资金融出)	客户证券账户 (资金融出)
BranchID	本方营业部代码	客户所在营业部代码 (资金融出)	客户所在营业部代码 (资金融出)
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	证券公司指定自营账户	证券公司指定自营账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格
PriceType	价格类型 1=Percentage, 表示收益率	1	1
ExpirationExecInst	到期续做方式	1=到期自动续做 2=到期手动续做	1=到期自动续做 2=到期手动续做
ExpirationDays	期限, 单位为天	品种期限	品种期限
MaturityDate	购回交易日	到期购回日	到期购回日
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号	暂不启用, 填全空格	暂不启用, 填全空格
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元	全空格	初始交易申报交易单元
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	全空格	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报日期	填 0	初始交易成交申报日期

说明:

(1) “证券代码 + 品种期限 + 到期购回日”可作为报价回购产品的唯一识别码。比如, 某证券公司的报价回购证券代码 132001 在 20120910 日申报的 1 天期初始交易 (20120911 日到期), 其报价回购产品唯一识别码为【132001,1,20120911】。

到期购回日为非交易日的, 券商技术系统在申报初始交易与提前购回交易指令时, 应当将到期购回日填写为相应的非交易日。

(2) TradeReportID (客户成交申报编号) 同一交易单元一个交易日内申报不得重复。

(3) ExpirationDays (期限) 表示品种期限, 提前购回交易指令中的品种期限应当等于对应初始交易指令中的品种期限。

(4) PriceType (价格类型) 指 LastPx (价格) 字段的业务含义, 目前取值为“1”, 表示百元资金年收益。比如 LastPx (价格) 的数据值为 3.5010 表示每百元资金的到期年收益为 3.5010 元。

(5) 当客户提前购回时, 券商技术系统应当按照当期产品申报提前购回交易

指令，且提前购回交易指令中的 OrigSubmittingPBUID（初始交易申报交易单元）等于对应初始交易指令的 SubmittingPBUID（申报交易单元），OrigTradeReportID（初始交易客户成交申报编号）等于对应初始交易指令的 TradeReportID（客户成交申报编号），OrigTradeDate（初始交易成交申报日期）等于对应初始交易的申报日期。

### 3.2 STEP 接口委托申报

表 3-2 STEP 接口成交申报消息定义

Tag	域名	字段描述	初始交易字段取值	提前购回字段取值
	MessageHeader	MsgType=AE		
1180	ApplID	应用标识	110=报价回购	110=报价回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	成交申报所有者类型	102=会员发起	102=会员发起
828	TrdType	成交申报业务类别	1021=质押式报价回购初始交易	1022=质押式报价回购提前购回
856	TradeReportType	成交申报类型 0= Submit, 提交成交申报	0	0
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报	0	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	1
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间
<b>组件&lt;Instrument&gt;</b>				
48	SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交	102	102

		易所			
<b>组件结束</b>					
<b>组件&lt;RootParties&gt;</b>					
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2	3	
→	1117	RootPartyID	参与人代码	报价回购指定交易单元	
	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	01=中国结算深圳分公司	
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	F=交割机构	
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	4=结算机构代码	
	1117	RootPartyID	参与人代码	不需要填写	
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	不需要填写	
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	不需要填写	
<b>组件结束</b>					
<b>组件&lt;TrdCapRptSideGrp&gt;</b>					
552	NoSides	side 个数	2	2	
→	54	Side	买卖方向	1=客户方（资金融出）	
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>				
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3	3
	→	448	PartyID	参与人代码	客户交易单元
		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	客户营业部代码
		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	2=证券公司	2=证券公司
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>				

	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	1	1
	→	448	PartyID	参与人代码	证券公司指定自营账户
		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
组件结束					
组件结束					
31	LastPx		价格	初始交易申报价格	提前购回申报价格
32	LastQty		数量	初始交易申报数量	提前购回申报数量
8911	ExpirationDays		期限, 单位为天	品种期限	品种期限
541	MaturityDate		购回交易日	到期购回日	到期购回日
8907	ExpirationExecInst		到期续做方式	1=到期自动续做 2=到期手动续做	1=到期自动续做 2=到期手动续做
423	PriceType		价格类型 1=Percentage, 表示收益率	1	1
10182	OrigTradeReportID		初始交易客户成交申报编号	不需要填写	初始交易客户成交申报编号
1125	OrigTradeDate		初始交易成交申报日期	不需要填写	初始交易成交申报日期

说明：字段取值参见 Binary 接口说明部分。

### 3.3 委托申报样例

某证券公司（008888 交易单元、0866666666 证券账户）与客户（006666 交易单元、0055555555 证券账户）在 20120601 日达成初始交易，报价回购产品唯一识别码为【132001,28,20120629】，到期购回每百元资金年收益为 5.2040 元，提前购回每百元资金年收益为 0.5000 元，客户选择 10000 张（即 100 万元人民币），产品到期自动续做；20120620 日客户提前购回。

#### 3.3.1 Binary 消息示例

表 3-3 申报 BINARY 消息示例

域名	20120601 日申报初始交易	20120620 日申报提前购回交易
MsgType	101103	101103
ApplID	110	110
SubmittingPBUID	008888	008888
SecurityID	132001	132001

SecurityIDSource	102	102
OwnerType	102	102
ClearingFirm	01	01
TransactTime	20120601-14:42:13:555	20120620-14:42:13:555
UserInfo	全空格	全空格
TradeReportID	A0000001	A0000002
TradeReportType	0	0
TradeReportTransType	0	0
TradeHandlingInstr	1	1
TradeReportRefID	全空格	全空格
LastPx	5.2040	0.5000
LastQty	10000.00	10000.00
TrdType	1021	1022
TrdSubType	0	0
ConfirmID	全空格	全空格
Side	1	1
PBUID	006666	006666
AccountID	0055555555	0055555555
BranchID	AA	AA
CounterpartyPBUID	全空格	全空格
CounterpartyAccountID	0866666666	0866666666
CounterpartyBranchID	全空格	全空格
PriceType	1	1
ExpirationExecInst	1	1
ExpirationDays	28	28
MaturityDate	20120629	20120629
OrigTradeID	全空格	全空格
OrigSubmittingPBUID	全空格	008888
OrigTradeReportID	全空格	A0000001
OrigTradeDate	0	20120601

### 3.3.2 STEP 消息示例

20120601 日申报初始交易：

1180=110<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>828=1021<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20120601-14:42:13:555<SOH>48=132001<SOH>22=102<SOH>1116=2<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=1<SOH>453=3<SOH>448

=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=2<SOH>453=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=5.2040<SOH>32=10000.00<SOH>8911=28<SOH>541=20120629<SOH>8907=1<SOH>423=1<SOH>

20120620 日申报提前购回交易：

1180=110<SOH>571=A0000002<SOH>522=102<SOH>828=1022<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20120620-14:42:13:555<SOH>48=132001<SOH>22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH>1119=4<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>552=2<SOH>54=1<SOH>453=3<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AA<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=2<SOH>453=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.5000<SOH>32=10000.00<SOH>8911=28<SOH>541=20120629<SOH>8907=1<SOH>423=1<SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20120601<SOH>

#### 四、 成交申报响应

对于报价回购业务的委托申报，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份额前端监控、资金前端监控、委托查询、清算、交收等所有业务处理。

##### 4.1 Binary 接口成交申报响应

表 4-1 Binary 成交申报响应消息定义

域名	字段描述	初始交易	提前购回
Standard Header	消息头 MsgType=201104		
ReportIndex	回报记录号		
ApplID	应用标识	110=报价回购	110=报价回购
ReportingPBUID	回报交易单元	报价回购委托申报交易单元	报价回购委托申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	报价回购委托申报交易单元	报价回购委托申报交易单元

SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码
SecurityIDSource	证券代码源	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
TransactTime	回报时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间
UserInfo	用户私有信息	用户私有信息	用户私有信息
TradeID	交易所成交申报编号		
TradeReportID	客户成交申报编号	客户订单编号	客户订单编号
TradeReportType	成交申报类型	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
TradeReportTransType	成交申报事务类别	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
TradeHandlingInstr	成交申报模式	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	报价回购委托申报对应字段值	报价回购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	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝
TrdRptStatus	成交申报状态	成交申报状态 0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	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	初始交易申报价格	提前购回申报价格
LastQty	数量	初始交易申报数量	提前购回申报数量
TrdType	成交申报业务类别	1021=报价回购初始交易	1022=报价回购提前购回
TrdSubType	成交申报业务子类 预留	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
ConfirmID	约定号	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
ExecID	执行编号		
Side	本方参与者买卖方向	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
PBUID	本方交易单元	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
AccountID	本方证券账户	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
BranchID	本方营业部代码	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
PriceType	价格类型	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
ExpirationExecInst	到期续做方式	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值

ExpirationDays	期限, 单位为天	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
MaturityDate	购回交易日	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
OrigTradeID	初始交易交易所成交申报编号	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	报价回购委托申报对应字段值	报价回购委托申报对应字段值
OrigTradeDate	初始交易成交申报申报日期	报价回购委托申报对应字段值	报价回购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 接口成交申报响应

表 4-2 STEP 成交申报响应消息定义

Tag	域名	字段描述	初始交易	提前购回
	MessageHeader	MsgType=AR		
10179	ReportIndex	回报记录号		
1180	ApplID	应用标识	110=报价回购	110=报价回购
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	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	成交申报所有者类型	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
828	TrdType	成交申报业务类别	1021=报价回购初始交 易	1022=报价回购提前购回
856	TradeReportType	成交申报类型	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
487	TradeReportTrans Type	成交申报事务类别	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
8912	TrdAckStatus	成交申报响应状态	0=Accepted, 接受	0=Accepted, 接受



			1=Rejected, 拒绝	1=Rejected, 拒绝	
939	TrdRptStatus	成交申报状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	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	回报时间	成交申报响应生成时间	成交申报响应生成时间	
<b>组件&lt;Instrument&gt;</b>					
48	SecurityID	证券代码	证券代码	证券代码	
22	SecurityIDSource	证券代码源	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值	
<b>组件结束</b>					
<b>组件&lt;RootParties&gt;</b>					
1116	NoRootPartyIDs	参与者代码个数	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值	
→	1117	RootPartyID	参与者代码	报价回购委托申报对应字 段值	
	1118	RootPartyIDSource	参与者代码源	报价回购委托申报对应字 段值	
	1119	RootPartyRole	参与者代码角色	报价回购委托申报对应字 段值	
<b>组件结束</b>					
<b>组件&lt;TrdCapRptSideGrp&gt;</b>					
552	NoSides	side 个数	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值	
→	54	Side	买卖方向	报价回购委托申报对应字 段值	
	<b>组件&lt;Parties&gt;</b>				
	453	NoPartyIDs	参与者代码个数	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
	→	448	PartyID	参与者代码	报价回购委托申报对应 字段值
		447	PartyIDSource	参与者代码源	报价回购委托申报对应 字段值
		452	PartyRole	参与者代码角色	报价回购委托申报对应

			字段值	段值
组件结束				
组件结束				
17	ExecID	执行编号		
31	LastPx	成交价格	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
32	LastQty	成交数量	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
8911	ExpirationDays	期限	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
541	MaturityDate	购回交易日	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
8907	ExpirationExecInst	到期续作方式	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
423	PriceType	价格类型	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
1126	OrigTradeID	初始交易交易所成交 申报编号	全空格	全空格
10182	OrigTradeReportID	初始交易客户成交申 报编号	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值
1125	OrigTradeDate	初始交易成交申报申 报日期	报价回购委托申报对应 字段值	报价回购委托申报对应字 段值

## 五、清算和交收

报价回购采用 T 日双边净额清算、T+1 日净额非担保交收的清算交收方式，若 T+1 日交收资金不足，则 T+1 日应交收的业务全部延迟至 T+2 日交收。

中国结算深圳分公司将通过 D-COM 系统向相关结算参与者发送 SJSMX1.DBF、SJSQS.DBF 及 SJSJG.DBF 三个接口文件，分别表示报价回购业务的逐笔清算明细、资金清算汇总数据及交收结果明细。报价回购两类业务类别 BJCS、BJDQ，分别表示报价回购的初始交易及购回交易。

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

## 六、 业务数据报送

为满足本所对报价回购业务监管的需要,开展报价回购业务的券商应当向深交所报送相关业务报表。报价回购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、报价回购业务数据报送指南](#)。

## 七、 开展报价回购业务的券商系统注意事项

### 7.1 行情相关说明

报价回购业务的证券基本资料与成交行情等信息均不会反映到实时行情中。

### 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,以支持报价回购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、价格等要素必须符合《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》以及证券公司事先向深交所报备的业务方案。

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。非签约客户不得录入该类业务的委托,或券商技术系统拒绝非签约客户委托。

对于出券方,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,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。

#### ◇ 向交易系统申报委托

接受投资者报价回购业务的委托指令后,按照数据接口规范所约定的内容使用

交易网关向交易系统申报委托。

每一次申报的合同序号不能重复,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关部门的审批额度,控制其业务总规模与各期子品种规模,避免业务风险。

#### ◇ 相关税费收取

报价回购业务的相关税费标准,参照债券回购执行。

## 八、 联系方式

业务: 0755-88668572 (交易)

0755-21899261 (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、报价回购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报价回购业务的自动撤单原因及其解释说明。

交易主机自动撤单含义表

原因代码	原因简称	原因说明
20005	业务禁止	标的证券无报价回购初始或提前购回的交易权限
20008	价格错误	委托价格不是价格档位的整数倍
20010	数量非法	委托数量不是初始交易或者提前购回的数量单位的整数倍
20011	量额非法	初始交易或提前购回的数量小于最低初始交易或提前购回下限数量
20022	股份卖空	初始交易申报委托交易数量大于可用标准券张数
20028	无效单元	交易单元无对应产品的业务权限
20056	无效账户	账户不为报价产品对应的证券公司专用证券账户
20060	仓位不足	提前购回交易数量大于未到期合约张数
20068	结算机构错	报价回购委托的结算机构不为中国证券登记结算公司深圳分公司
20099	重单	重单

## 附件二、报价回购业务的结算数据接口修订说明

### 1、接口简要说明

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、SJSQS.DBF 及 SJSJG.DBF 三个接口文件，分别表示报价回购业务的逐笔清算明细、资金清算汇总数据及交收结果明细。报价回购两类业务类别 BJCS、BJDQ，分别表示报价回购的初始交易及购回交易，具体请见下文 SJSMX1.DBF、SJSQS.DBF 及 SJSJG.DBF 等接口中的定义。

(1)中国结算深圳分公司每日通过 SJSMX1.DBF 发送 T 日的报价回购交易(包括初始交易、系统自动触发的到期购回交易、及提前购回交易)的清算明细。

(2) 每日通过 SJSQS.DBF 向相关结算参与人发送 T+1 日应交收的报价回购资金汇总清算数据，其中可能包括 T-1 日交易延迟至 T+1 交收及 T 日交易的数据。

(3) 每日通过 SJSJG.DBF 发送 T 日的交收明细结果，其中可能包括 T-2 日交易的延迟交收及 T-1 日交易的正常交收结果。对 T-1 日的交易，若 T 日交收失败将会延迟至 T+1 日进行最后交收；对 T-2 日的交易在 T-1 日交收失败的，SJSJG.DBF 中的数据为最终交收结果。

报价回购的质押券质押解押，及担保资金提取采用 D-COM 的 FJYBS.DBF 接口申报，其业务类别分别为 70、72 和 74，其实时检查结果通过 FJYQR.DBF 反馈。

报价回购其余相关数据的发送与债券质押式回购类似：其中未到期回购合约通过 SJSJG.DBF 的 ZQHY 业务类别以通知类数据下发；标准券余额数据通过 SJSFW.DBF 的 21 业务类别数据下发；质押明细数据通过 SJSFW.DBF 的 22 业务类别数据下发。其中报价回购业务与其它质押式回购业务的数据通过回购标准券代号区分。担保资金提取的处理结果体现在日终的 SJSZJ.DBF 中。

### 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）》。

SJSMX1.DBF 中业务类别为：

业务类别	业务类别含义
BJCS	报价回购初始交易
BJDQ	报价回购购回交易

SJSMX1.DBF 的数据填写说明如下：

字段名	业务类别	
	BJCS (报价回购业务 初始交易)	BJDQ(报价回购购回 交易)
MXJSZH	结算账号	结算账号
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'
MXYWLB	'BJCS'	'BJDQ'
MXZQDM	证券代码	证券代码
MXJYDY	交易单元	交易单元
MXTGDY	托管单元	托管单元
MXZQZH	证券账户	证券账户
MXDDBH	订单编号	订单编号 到期自动购回时，本 字段为初始交易合 同序号
MXYYB	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号 到期自动购回时，本 字段为初始交易的 执行编号
MXYWLSH	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量	成交数量
MXQSSL	清算数量	清算数量 对无效的提前购回 交易，本字段为 0

MXCJJG	交易回报价格	交易回报价格
MXQSJG	最终清算价格	最终清算价格 对无效的提前购回 交易，本字段为 0。
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	证券类别	证券类别
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	'00'	'00'
MXJSFS	'N'	'N'
MXHBDH	货币代号	货币代号
MXQSBJ	清算本金	清算本金
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		
MXQSYJ		
MXQTFY		
MXZJJE		
MXSFJE	收付净额	收付净额
MXCJRQ	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日
MXJSRQ	T+1 日	T+1 日
MXFSRQ	T 日	T 日
MXQTRQ	到期日期	
MXSCDM		
MXJYFS	'02'	'02'
MXZQDM2		
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH	错误代号	错误代号
MXPPHM		
MXFJSM		初始交易合同序号
MXBYBZ		



比如,某证券公司(008888 交易单元、0866666666 证券账户,对应 B001008888 备付金账户)与客户(006666 交易单元、0055555555 证券账户、对应 B001006666 备付金账户)在 20120601 日达成初始交易,报价回购产品唯一识别码为【132001,28,20120629】,到期购回每百元资金年收益为 5.204 元,提前购回每百元资金年收益为 0.500 元,客户选择 10000 张(即 100 万元人民币),产品到期自动续做;20120620 日客户提前购回,或 20120629 到期自动购回。结算系统发出的清算明细数据 SJSMX1.DBF 如下表所示:

字段名	20120601 初始交易		20120620 提前购回		20120629 到期自动购回	
	交易单元	证券账户	交易单元	证券账户	交易单元	证券账户
MXJSZH	008888	006666	008888	006666	008888	006666
MXBFZH	B001008888	B001006666	B001008888	B001006666	B001008888	B001006666
MXSJLX	01	01	01	01	01	01
MXYWLB	BJCS	BJCS	BJDQ	BJDQ	BJDQ	BJDQ
MXZQDM	132001	132001	132001	132001	132001	132001
MXJYDY	008888	006666	008888	006666	008888	006666
MXTGDY	008888	006666	008888	006666	008888	006666
MXZQZH	0866666666	0055555555	0866666666	0055555555	0866666666	0055555555
MXDDBH	XY000001	XY000001	XY000008	XY000008	XY000001	XY000001
MXYYB	XY	XY	XY	XY	XY	XY
MXZXBH	0201000000000001	0201000000000001	0201000000000039	0201000000000039	0201000000000001	0201000000000001
MXYWLSH	120601100000001	120601100000002	120620100000001	120620100000002	120629100000001	120629100000002
MXCJSL	-10000	10000	10000	-10000	10000	-10000
MXQSSL	-10000	10000	10000	-10000	10000	-10000
MXCJG	100.00	100.00	100.026027397	100.026027397	100.399210959	100.399210959
MXQSJG	100.00	100.00	100.026027397	100.026027397	100.399210959	100.399210959
MXXYJY						
MXPCBS						
MXZQLB	13	13	13	13	13	13
MXZQZL						
MXGFXZ	00	00	00	00	00	00
MXJSFS	N	N	N	N	N	N
MXHBDH	RMB	RMB	RMB	RMB	RMB	RMB
MXQSBJ	1,000,000.00	-1,000,000.00	-1,000,260.27	1,000,260.27	-1,003,992.11	1,003,992.11
MXYHS	0	0	0	0	0	0
MXJYJSF	0	0	0	0	0	0

字段名	20120601 初始交易		20120620 提前购回		20120629 到期自动购回	
MXJGGF	0	0	0	0	0	0
MXGHF	0	0	0	0	0	0
MXJSF	0	0	0	0	0	0
MXSXF						
MXQSYJ						
MXQTFY						
MXZJJE						
MXSFJE	1,000,000.00	-1,000,000.00	-1,000,260.27	1,000,260.27	-1,003,992.11	1,003,992.11
MXCJRQ	20120601	20120601	20120620	20120620	20120629	20120629
MXQSRQ	20120601	20120601	20120620	20120620	20120629	20120629
MXJSRQ	20120602	20120602	20120621	20120621	20120702	20120702
MXFSRQ	20120601	20120601	20120620	20120620	20120629	20120629
MXQTRQ	20120629	20120629				
MXSCDM						
MXJYFS	02	02	02	02	02	02
MXZQDM 2						
MXTGDY 2						
MXPPHM						
MXFJSM			008888201206 01XY000001	008888201206 01XY000001	008888201206 01XY000001	008888201206 01XY000001
MXBYBZ						

### 3、资金清算汇总库 SJSQS.DBF

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 (结算参与者版 V5.02)》。

SJSQS.DBF 接口中新增一类数据，如下表所示：

QSYWLB	相应业务含义	说明
BJCS	报价回购初始交易清算数据	QSZQDM 为证券代码。 成交日期=清算日期 对非延迟交收的，交收日期=清算日期+1；对延迟交收的，交收日期=原交收日期+1
BJDQ	报价回购购回交易清算数据	QSZQDM 为证券代码。 成交日期=清算日期 对非延迟交收的，交收日期=清算日期+1；对延迟交收的，交收日期=原交收日期+1

证券公司需自行将 SJSQS 中按备付金账户为单位将 BJCS、BJDQ 这两类业务类别的数据轧差，根据轧差所得结果准备报价回购的交收资金。

#### 4、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 T 日的 SJSJG.DBF 中的 BJCS、BJDQ 业务，其交收结果体现在 T+1 日的 SJSJG.DBF 中，JGCJRQ 为 T 日，JGQSRQ 为 T 日，JSJSRQ 为 T+1 日；对于 T+1 日交收失败延迟至 T+2 交收的情况，JGCJRQ 为 T 日，JSQSRQ 为 T+1 日，JGJSRQ 为 T+2 日。

另外，SJSJG 中也包含当日购回交易的无效指令，JGZYDH 为其错误代号。

SJSJG 的填写方式如下：

字段名	业务类别	
	BJCS (报价回购初始交易)	BJDQ (报价回购购回交易)
JGJSZH	结算账号	结算账号
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'BJCS'	'BJDQ'
JGZQDM	证券代码	证券代码
JGJYDY	交易单元	交易单元
JGTGDY	托管单元	托管单元
JGZQZH	证券账户号码	证券账户号码
JGDDBH	订单编号	订单编号
JGYYB	营业部代码	营业部代码
JGZXBH	执行编号	执行编号
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号
JGCJSL	成交数量	成交数量

JGQSSL	清算数量	清算数量 对于购回交易无效指令, 为 0
JGJSSL	交收数量 若交收失败, 则为 0	交收数量 若交收失败, 则为 0 对于购回交易无效指令, 为 0
JGCJJG	成交价格	成交价格
JGQSJG	清算价格	清算价格 对于购回交易无效指令, 为 0
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	证券类别	证券类别
JGZQZL		
JGGFXZ	'00'	'00'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBDH	货币代号	货币代号
JGQSBJ	清算本金	清算本金 对于购回交易无效指令, 为 0
JGYHS	印花税	印花税
JGJYJSF	交易经手费	交易经手费
JGJGGF	监管规费	监管规费
JGGHF	过户费	过户费
JGJSF	结算费	结算费
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	收付净额	收付净额
JGJSBZ	'Y' 或 'N'	'Y' 或 'N'
JGZYDH	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号
JGCJRQ	T-2 日或 T-1 日 对于延迟交收, 为 T-2 日 对于正常交收, 为 T-1 日	T-2 日或 T-1 日或 T 日 对于延迟交收, 为 T-2 日 对于正常交收, 为 T-1 日 对于购回交易无效指令, 为 T 日
JGQSRQ	T-1 日	T-1 日

JGJSRQ	T 日	T 日
JGFSRQ	T 日	T 日
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM		
JGBYBZ		

对报价回购业务，质押解押委托处理结果、派息兑付资金解押、未到期回购合约等数据接口与债券质押式回购所对应业务的接口类似，质押解押处理结果及派息兑付资金自动解押通过 ZYRK、ZYCK 业务类别数据下发，通过 JGZQDM2 填写的标准券代码区分不同的回购产品；未到期回购合约通过 ZQHY 业务类别数据下发。

### 5、资金变动库 SJSZJ.DBF

资金变动库 SJSZJ.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）》。

SJSZJ.DBF 中填写方式：

ZJYWLB	业务类别含义	ZJZQDM
ZJ00	结算头寸存入或调出	空
ZJCK	报价回购担保资金提取	证券代码

报价回购的担保资金提交由日间通过 D-COM 终端办理实时划付，担保资金提取则通过 FJYBS.DBF 申报，日终统一处理。这两类业务引起的自营备付金账户及担保资金账户的资金变动都体现在日终的 SJSZJ.DBF 中，其业务类别分别为 ZJ00（结算头寸存入或调出）、ZJCK（担保资金提取）。对自营备付金账户，担保资金提交的发生金额为负，提取的发生金额为正；对担保资金账户，担保资金提交的发生金额为正，提取的发生金额为负。

报价回购担保资金账户余额，可通过 D-COM 终端中资金划拨模块中资金余额查询进行实时查询。

### 6、非交易报送库 FJYBS.DBF 与非交易确认库 FJYQR.DBF

非交易报送库 FJYBS.DBF 与非交易确认库 FJYQR.DBF 的具体结构参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》。

FJYBS.DBF 中三类业务指令标识报价回购质押解押委托及担保资金提取委托：

BSYWLB	BSWTLX	业务字段的填报说明
70（报价回购质押委托）	S/申报	BSZQDM,BSGDDM,BSXWDM,BSWTSL,BSYWSJ BSYWSJ 字段左起 1-6 位填写报价回购的标准券代号
	C/撤单	无 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
72（报价回购解押委托）	S/申报	BSZQDM,BSGDDM,BSXWDM,BSWTSL,BSYWSJ BSYWSJ 字段左起 1-6 位填写报价回购的标准券代号
	C/撤单	无 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。
74（报价回购担保资金提取委托）	S/申报	BSXWDM,BSYWSJ,BSWTZJ BSYWSJ 字段左起 1-6 位填写报价回购的标准券代号
	C/撤单	无 BSWTXH 为原申报委托时填报的委托序号。

### 8、综合服务库 SJSFW.DBF

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）》。

与债券质押式回购所对应业务的接口类似，其中账户标准券余额=当前质押券折算成的标准券总量+担保资金账户金额折算成的标准券总量-未到期回购占用标准券总量，通过 SJSFW.DBF 的 21 类别数据下发；质押明细数据通过 SJSFW 的 22 类别数据下发，通过对应的标准券代码区分不同回购的质押明细。

### 9、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、报价回购业务数据报送指南

### 1、业务要求说明

为满足交易所对报价回购业务监管的需要，确保报价回购业务顺利开展，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 日报价回购相关业务数据文件。内容包括：报价回购合格投资者报告、报价回购业务规模报告等数据文件。各类数据文件说明如下：

(1) 报价回购合格投资者报告：填报券商最近一次报价回购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) 报价回购业务规模报告：券商 T 日报价回购的业务整体情况，包括券商已发行的所有期限品种的子品种（注：子品种具备同一品种期限及同一到期购回日期）；对于同一子品种（证券代码 + 品种期限 + 到期购回日）的不同报价，应按每个报价一条记录分别申报；对于 T 日到期的子品种，在 T 日报送之后，可不再报送。

### 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
报价回购合格投资者报告	BJHG0000_20120810.dbf
报价回购业务规模报告	BJHG0001_20120810.dbf

券商通过深交所会员业务专区的“公文及报表上传”报送报价回购业务数据文件，要求一次性报送所有的报价回购业务数据文件（2 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、报价回购合格投资者报告 BJHG0000\_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	'BJHG'=报价回购
2	ZQZH	客户证券账户号	C	10	
3	KHMC	客户名称	C	128	
4	ZJLB	客户证件类别	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	客户协议和风险揭示书 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

报价回购合格投资者报告：券商最近一次报价回购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 'BJHG'，表示报价回购的合格投资者报告。

(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）在券商处进行报价回购交易权限；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 (客户协议和风险揭示书签署日期):投资者与券商签订客户协议和风险揭示书的日期。

(6) KTRQ (交易权限开通日期):允许投资者在券商处进行报价回购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报价回购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、报价回购业务规模报告 BJHG0001\_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	PZQX	品种期限	N	4,0	单位:天数
3	FXRQ	子品种发行日期	C	8	格式:CCYYMMDD
4	DQRQ	子品种到期日期	C	8	格式:CCYYMMDD
5	BJJG	子品种当日报价	N	9,3	单位:人民币元
6	FXFS	子品种发行方式	C	1	0=定期发行 1=不定期发行
7	CXTS	子品种已存续天数	N	4,0	单位:天数
8	SYTS	子品种剩余天数	N	4,0	单位:天数
9	WGHS	子品种未到期购回数量	N	10,0	单位:张
10	WGHJE	子品种未到期购回金额	N	18,2	单位:人民币元
11	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段,全空格

报价回购业务规模报告:券商 T 日报价回购的业务整体情况,包括券商已发行的所有期限品种的子品种(注:子品种具备同一品种期限及同一到期购回日期);对于 T 日到期的子品种,在 T 日的数据报送之后,可不再报送。

(1) ZQDM (证券代码):券商报价回购的产品标识。

(2) GHQX (品种期限):报价回购产品的具体品种(如 1 天期、7 天期、14 天期的期限等)的购回期限。如是 1 天期品种,则填报 1;7 天期品种,则填报 7;以此类推。

(3) FXRQ (子品种发行日期): 该品种下当前子品种的发行日期。例如, 2012年9月24日发行的7天期品种, 其子品种发行日期为2012-9-24。

(4) DQRQ (子品种到期日期): 该品种下的当前子品种的到期日期, 其值等于子品种发行日期+品种期限。

(5) BJJG (子品种当日报价): 对于 FXFS='0' (定期发行) 的子品种, 填写券商 T 日该子品种的每百元年收益报价, 如果 T 日有多个报价, 应按每个报价单独一条记录申报。对于 FXFS='1' (不定期发行) 的子品种, 固定填写为发行日的该子品种的每百元年收益报价, 如果发行日有多个报价, 应按每个报价单独一条记录申报。

(6) FXFS(子品种发行方式): 对于定期发行的子品种, 设置为 '0'; 对于不定期发行的子品种, 设置为 '1'。定期发行, 是指以两个特定日期作为子品种发行日、子品种到期日, 在两个特定日期中间可以新开在子品种到期日到期的、期限可不标准的初始交易的发行方式。不定期发行, 是指每一交易日, 每个品种均可新开期限标准的初始交易的发行方式。

(7) CXTS (子品种已存续天数): 截止 T 日, 该品种下的当前子品种已经存续的自然日天数, 其数值等于 (T 日日期-子品种发行日期) 天。

(8) SYTS (子品种剩余天数): 截止 T 日, 该品种下的当前子品种距离子品种到期日期的自然日天数, 其数值等于 (购回日期-T 日日期) 天。

(9) WGHSL (子品种未到期购回数量): 截止 T 日, 该品种的当前子品种该报价下所有未到期的初始交易剩余数量之和, 包括 T 日新开仓的初始交易。

(10) WGHJE (子品种未到期购回金额): 截止 T 日, 该品种的当前子品种该报价下所有未到期的初始交易剩余数量涉及的购回金额之和, 包括 T 日新开仓的初始交易。