



深圳证券交易所工程技术文档

工程技术标准

股票质押式回购交易业务之
券商技术系统变更指南
(Ver1.11)



深圳证券交易所
中国结算深圳分公司
二〇一七年二月

关于本文档

文档名称		股票质押式回购交易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
2013-03-11	0.90	创建文档	征求意见稿
2013-03-22	1.00	修订文档	根据相关券商的反馈意见修订
2013-05-31	1.01	修订文档	<p>1、详细说明综合委托库 SJSZHWT.dbf 的 WTWTSL2（字段10：委托数量2）、综合回报库 SJSZH HB.dbf 中的 HBHBSL2（字段20：回报数量2）。</p> <p>2、修订结算数据接口中的一些笔误，交易经手费字段不是 MXJSF 和 JGJSF，应该是 MXJYF 和 JGJYF。细化了一些结算数据接口说明。</p>
2014-06-25	1.02	修订文档	新增一类违约处置电子指令；
2014-12-05	1.03	修订文档	购回交易指令新增“部分购回”的购回方式，根据结算系统优化数据接口重新描述接口。
2016-07-31	1.10	修订文档	升级到新一代交易系统数据接口
2017-02-16	1.11	修订文档	<p>(本档中橙色修订部分)</p> <p>股票质押回购盯市报告添加5个字段；</p> <p>初始交易指令新增资金用途类型、预警线、平仓线、利率四个字段；</p> <p>新增违约处置撤销指令；</p> <p>根据结算二期优化修订部分接口。</p>

目 录

一、	说明.....	1
二、	业务简介.....	1
2.1	交易流程.....	1
2.2	标的证券代码.....	2
2.3	交易单元.....	2
2.4	合格融入方、融出方.....	2
2.5	其他说明.....	3
三、	成交申报.....	3
3.1	Binary 接口委托申报.....	1
3.2	STEP 接口委托申报.....	1
3.3	委托申报样例.....	1
四、	成交申报响应.....	3
4.1	Binary 接口成交申报响应.....	4
4.2	STEP 接口成交申报响应.....	5
五、	清算和交收.....	1
六、	业务数据报送.....	1
七、	开展股票质押回购业务的券商系统注意事项.....	1
7.1	行情相关说明.....	1
7.2	委托相关说明.....	1
7.3	关于客户委托服务渠道.....	1
7.4	关于券商柜台系统.....	1
八、	联系方式.....	2
附件一、	股票质押回购业务的交易数据接口修订说明.....	3
附件二、	股票质押回购业务的结算数据接口修订说明.....	5
1、	接口修订简要说明.....	5
2、	清算明细库 SJSMX0.DBF.....	6
3、	交收明细结果库 SJSJG.DBF.....	11
4、	综合数据服务库 SJSFW.DBF.....	34
5、	其它信息.....	36
附件三、	股票质押回购业务数据报送指南.....	37
1、	业务要求说明.....	37
2、	技术要求说明.....	37
3、	股票质押回购融入方报告 ZYHG0000_ccyymmdd.dbf.....	37

4、股票质押回购融出方报告 ZYHG0001_ccyymmdd.dbf	39
5、股票质押回购盯市报告 ZYHG0002_ccyymmdd.dbf	39

股票质押式回购交易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股票质押式回购交易（以下简称“股票质押回购”）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

股票质押式回购交易（以下简称“股票质押回购”）业务是指符合条件的资金融入方（以下简称“融入方”）以所持有的股票或其他证券质押，向符合条件的资金融出方（以下简称“融出方”）融入资金，并约定在未来返还资金、解除质押的交易。

2.1 交易流程

(1) 融入方、融出方、证券公司签署股票质押回购交易业务协议；

(2) 证券公司根据融入方、融出方的委托，按照规定格式提交初始交易指令；

(3) 深交所交易系统对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。**初始交易成功交收后，质押标的证券将在融入方交易单元进行质押冻结；**

(4) 待购回期间，融入方可以按约定补充提交标的证券进行质押登记，证券公司向深交所提交补充质押指令；待购回期间，融出方可以部分解除标的证券或孳息质押登记，证券公司向深交所提交部分解除质押指令；

(5) 深交所交易系统对补充质押指令和部分解除质押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；

(6) 购回交易日（可以是到期购回日，或双方协商一致的提前购回日、延期购回日或终止购回日或部分购回日），证券公司按照规定格式提交购回交易指令；

(7) 若无法正常购回，依据业务协议的约定须处置质押标的证券的，证券公司按照规定格式提交违约处置指令。违约处置成功交收后，质押标的证券将转托管至质押特别交易单元，证券公司可以通过质押特别交易单元卖出相应证券；

(8) 已提交违约处置指令并成交后，如果发生融入方可以提前购回、可以补充质押等不再需要通过违约处置卖出质押标的证券情形的，不论证券公司是否已经实际卖出质押标的证券，证券公司可通过提交违约处置撤销指令，将合约状态恢复为正常，违约处置撤销指令成功交收后，质押标的证券将转托管至融入方交易单元，可正常申报补充质押、部分解除质押、购回交易、违约处置指令；

(9) 深交所交易系统对购回交易指令、违约处置指令、违约处置撤销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；

(10) 中国结算深圳分公司依据深交所确认的成交结果为股票质押回购提供相应的证券质押登记和清算交收等服务。

2.2 标的证券代码

标的证券应符合深交所和中国结算规定的范围以及证券公司标的证券管理制度，并由融入方和融出方协商确定。

深交所和中国结算规定的标的证券范围：上市交易的 A 股股票或其他深交所认可的证券，B 股股票、暂停上市 A 股股票、进入退市整理期 A 股股票、没有完成股改的非流通股股票、股权激励限售股不得作为标的证券。

2.3 交易单元

股票质押回购的指令只能通过会员申请的指定交易单元申报。

证券公司还应申请一个质押特别交易单元，用于质押标的证券的处置。质押特别交易单元不得用于除违约处置外的证券交易。

指定申报交易单元与质押特别交易单元不得为同一交易单元。

质押标的证券托管、转托管涉及的托管单元见结算数据接口部分。

2.4 合格融入方、融出方

证券公司应当对融入方、融出方实施适当性管理，并向交易所报备合格融入方、融出方相关情况。

2.5 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) 交易品种的回购期限应符合规定。
- (3) 初始交易确认成交的, 当日可申报购回交易、补充质押和部分解除质押。
- (4) 证券公司应当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、成交申报

股票质押式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。申报当日有效, 一经申报不得撤销。

股票质押式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	购回交易字段取值	补充质押字段取值	部分解除质押字段取值	违约处置、违约处置 撤销字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=100903					
ApplID	应用标识	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购
SubmittingPBUID	申报交易单元	股票质押式回购指定申报交易单元	股票质押式回购指定申报交易单元	股票质押式回购指定申报交易单元	股票质押式回购指定申报交易单元	股票质押式回购指定申报交易单元
SecurityID	证券代码	标的证券代码	部分购回:购回标的证券的证券代码 其他购回方式:全空格	标的证券代码	标的证券代码	全空格
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	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	102=会员发起	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	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司	01=中国结算深圳分公司
TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	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	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	客户订单编号	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	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
TradeReportTransType	成交申报事务类别	0	0	0	0	0

	0=New 1=Cancel					
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	1	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	全空格	全空格	全空格
LastPx	价格	年化利率, 单位为百分 比, 小数点后两位, 须大 于等于-99.9900 且小于 等于 99.9900	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
LastQty	数量	标的证券数量	部分购回: 购回标的证券 的数量 其他购回方式: 填 0.00	标的证券数量	标的证券数量	填 0.00
TrdType	成交申报业务类别	1001=股票质押式回购 初始交易	1002=股票质押式回购 提前购回 1003=股票质押式回购 到期购回 1004=股票质押式回购 延期购回 1005=股票质押式回购 终止购回 1009=股票质押式回购 部分购回	1006=股票质押式回购 补充质押	1007=股票质押式回购 部分解除质押	1008=股票质押式回购 违约处置 1010=股票质押式回购 违约处置撤销

TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0
ConfirmID	约定号	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	本方与人买卖方向	2=卖出	2=卖出	2=卖出	2=卖出	2=卖出
PBUID	本方交易单元	(资金)融入方交易单元	(资金)融入方交易单元	(资金)融入方交易单元	(资金)融入方交易单元	(资金)融入方交易单元
AccountID	本方证券账户	(资金)融入方证券账户	(资金)融入方证券账户	(资金)融入方证券账户	(资金)融入方证券账户	(资金)融入方证券账户
BranchID	本方营业部代码	(资金)融入方营业部代 码	(资金)融入方营业部代 码	(资金)融入方营业部代 码	(资金)融入方营业部代 码	(资金)融入方营业部代 码
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	(资金)融出方交易单元	(资金)融出方交易单元	(资金)融出方交易单元	(资金)融出方交易单元	(资金)融出方交易单元
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	(资金)融出方证券账户	(资金)融出方证券账户	(资金)融出方证券账户	(资金)融出方证券账户	(资金)融出方证券账户
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CashOrderQty	现金金额	初始交易金额	终止购回: 填 0.0000 其他购回方式: 购回交易 金额	填 0.0000	解除红利金额	填 0.0000
ShareProperty	股份性质	股份性质	部分购回: 购回标的证券 的股份性质 其他购回方式: 全空格	股份性质	股份性质	全空格
MaturityDate	购回交易日	购回交易日	购回交易日	填 0	填 0	填 0
PledgeeType	质权人类型	质权人类型	填 0	填 0	填 0	填 0
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	暂不启用, 填全空格	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	部分购回: 需购回的初始 交易或补充质押的申报 交易单元 其他购回方式: 初始交易	初始交易申报交易单元	需解除质押的初始交易 或补充质押的成交申报 交易单元	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	申报交易单元 部分购回:需购回的初始交易或补充质押的客户成交申报编号 其他购回方式:初始交易客户成交申报编号	初始交易客户成交申报编号	需解除质押的初始交易或补充质押的客户成交申报编号	初始交易客户成交申报编号
OrigTradeDate	初始交易成交申报日期	0	部分购回:需购回的初始交易或补充质押的交易日期 其他购回方式:初始交易日期	初始交易日期	需解除质押的初始交易或补充质押的成交申报日期	初始交易日期
InvestmentType	资金用途类型	01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他	固定填全空格	固定填全空格	固定填全空格	固定填全空格
AlertRatio	预警线, 单位为百分比	预警线	固定填 0.00	固定填 0.00	固定填 0.00	固定填 0.00
SettlementRatio	平仓线, 单位为百分比	平仓线	固定填 0.00	固定填 0.00	固定填 0.00	固定填 0.00

说明：

(1) SubmittingPBUID（申报交易单元）、PBUID（本方交易单元）和 CounterpartyPBUID（对手方交易单元）所属证券公司必须为同一证券公司。

(2) 标的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) 对于提前购回、到期购回、延期购回、终止购回和部分购回，购回交易指令中的购回交易日均应当等于对应初始交易指令中的购回交易日。

(4) 对于初始交易、购回交易（购回方式为提前购回、到期购回、延期购回和部分购回）指令，CashOrderQty（现金金额）字段值必须大于0；对于购回交易（购回方式为终止购回）指令、**违约处置指令**、**违约处置撤销指令**，CashOrderQty（现金金额）字段值必须等于0；对于部分解除质押指令，CashOrderQty（现金金额）字段值必须大于等于0，且该字段不得与LastQty（数量）字段同时为0。

(5) 对于初始交易、补充质押和购回交易（购回方式为部分购回）指令，LastQty（数量）字段值必须大于0；对于购回交易（购回方式为提前购回、到期购回、延期购回和终止购回）、**违约处置指令**和**违约处置撤销指令**，LastQty（数量）字段值必须等于0；对于部分解除质押指令，LastQty（数量）字段值必须大于等于0，且该字段不得与CashOrderQty（现金金额）字段同时为0。

(6) 若融入方、融出方均同意延期购回，则证券公司只需在延期后的实际购回日申报购回交易指令。

(7) 对于购回交易（购回方式为提前购回、到期购回、延期购回和终止购回）指令，证券公司无需申报证券代码、委托数量和股份性质，结算公司将根据初始交易合同序号，一并解除初始交易与补充质押的证券和资金的质押登记。对于购回交易（购回方式为部分购回）指令，证券公司需申报证券代码、委托数量和股份性质，结算公司将解除对应证券的相关质押登记。

(8) 对于**违约处置指令**，证券公司无需申报证券代码、委托数量和股份性质，结算公司将根据初始交易合同序号，一并解除初始交易与补充质押的证券和资金质押冻结，详见清算和交收部分。

(9) 对于初始交易、补充质押、部分解除质押和购回交易（购回方式为部分购回）指令，ShareProperty（股份性质）应当填写为标的证券股份性质代码，具体

取值以中国证券登记结算公司深圳分公司的相关规定为准，详见清算和交收部分。

(10) 对于初始交易指令，根据不同融出方类别与选择情况，由证券公司填写对应的 PledgeType（质权人类型）。

证券公司向深交所开通交易权限时，应当向深交所报备指定的申报交易单元代码、质押特别交易单元代码、资产管理子公司（若有）全称三个要素。其中，资管子公司全称适用于“3”和“7”两种情况：

融出方类别		质权人类型
(01) 当证券公司为融出方时，证券公司为质权人；		1
(02) 当证券公司集合或专项资产管理计划产品为融出方时，证券公司为登记的质权人		2
(03) 当证券公司资产管理子公司集合或专项资产管理计划产品为融出方时，证券公司资产管理子公司为登记的质权人		3
(04) 当证券公司定向资产管理客户为融出方时，可以选择	定向客户为登记的质权人	4
	证券公司为登记的质权人	5
(05) 当证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方时，可以选择	定向客户为登记的质权人	6
	证券公司资产管理子公司为登记的质权人	7

(11) 对于购回交易（购回方式为提前购回、到期购回、延期购回和终止购回）、补充质押、违约处置指令和违约处置撤销指令，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（初始交易成交申报申报日期）应当填写为对应初始交易的相应字段值。对于部分解除质押和购回交易（购回方式为部分购回）指令，OrigSubmittingPBUID、OrigTradeReportID、OrigTradeDate 应当填写为对应初始交易或对应补充质押的相应字段值。

(12) 对于初始交易，AlertRatio（预警线）和 SettlementRatio（平仓线）字段必须大于等于-9999.99 且小于 9999.99。

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	购回交易字段 取值	补充质押字段 取值	部分解除质押 字段取值	违约处置、违 约处置撤销字段 取值
	MessageHeader	MsgType=AE					
1180	ApplID	应用标识	090=股票质押式 回购	090=股票质押式 回购	090=股票质押式 回购	090=股票质押式 回购	090=股票质押式 回购
571	TradeReportID	客户成交申报编号	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号	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	102=会员发起	102=会员发起	102=会员发起
828	TrdType	成交申报业务类别	1001=股票质押式 回购初始交易	1002=股票质押式 回购提前购回 1003=股票质押式 回购到期购回 1004=股票质押式 回购延期购回 1005=股票质押式 回购终止购回 1009=股票质押式 回购部分购回	1006=股票质押式 回购补充质押	1007=股票质押式 回购部分解除质 押	1008=股票质押式 回购违约处置 1010=股票质押式 回购违约处置撤 销
856	TradeReportType	成交申报类型 0= Submit, 提交成交	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0	固定填 0

		申报					
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别 0=New, 新申报 1=Cancel, 撤销申报	0	0	0	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	1	1	1
60	TransactTime	成交申报发起时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间	委托申报时间
组件<Instrument>							
48	SecurityID	证券代码	标的证券代码	部分购回: 购回标 的证券的证券代 码 其他购回方式: 全 空格	标的证券代码	标的证券代码	全空格
22	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	102=深圳证券交 易所	102=深圳证券交 易所	102=深圳证券交 易所
组件结束							
组件<RootParties>							
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2	3	3	3	3
→	1117	RootPartyID	参与人代码	股票质押式回购 指定申报交易单	股票质押式回购 指定申报交易单	股票质押式回购 指定申报交易单	股票质押式回购 指定申报交易单

				元	元	元	元	元
1118	RootPartyIDSource	参与者代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
1119	RootPartyRole	参与者代码角色	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元	1=申报交易单元
1117	RootPartyID	参与者代码	不需要填写	部分购回：需购回的初始交易或补充质押的申报交易单元 其他购回方式：初始交易申报交易单元	初始交易申报交易单元	初始交易或补充质押的申报交易单元	初始交易申报交易单元	初始交易申报交易单元
1118	RootPartyIDSource	参与者代码源	不需要填写	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
1119	RootPartyRole	参与者代码角色	不需要填写	13=初始交易申报交易单元	13=初始交易申报交易单元	13=初始交易申报交易单元	13=初始交易申报交易单元	13=初始交易申报交易单元
1117	RootPartyID	参与者代码	结算机构代码	结算机构代码	结算机构代码	结算机构代码	结算机构代码	结算机构代码
1118	RootPartyIDSource	参与者代码源	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构	F=交割机构
1119	RootPartyRole	参与者代码角色	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码	4=结算机构代码
组件结束								
组件<TrdCapRptSideGrp>								
552	NoSides	side 个数	2	2	2	2	2	2
→	54	Side	买卖方向	2=（资金）融入方	2=（资金）融入方	2=（资金）融入方	2=（资金）融入方	2=（资金）融入方

组件<Parties>								
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	3	3	3	3	3	3
→	448	PartyID	参与人代码	融入方交易单元	融入方交易单元	融入方交易单元	融入方交易单元	融入方交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识
	452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
	448	PartyID	参与人代码	融入方证券账户	融入方证券账户	融入方证券账户	融入方证券账户	融入方证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	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	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
	448	PartyID	参与人代码	融入方营业部代码	融入方营业部代码	融入方营业部代码	融入方营业部代码	融入方营业部代码
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码	D=自定义代码
	452	PartyRole	参与人代码角色	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码	4001=营业部代码
组件结束								
54	Side	买卖方向	1=（资金）融出方	1=（资金）融出方	1=（资金）融出方	1=（资金）融出方	1=（资金）融出方	1=（资金）融出方
组件<Parties>								
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	2	2	2	2	2	2
→	448	PartyID	参与人代码	融出方交易单元	融出方交易单元	融出方交易单元	融出方交易单元	融出方交易单元
	447	PartyIDSource	参与人代码源	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识	C=通用市场参与者标识

	452	PartyRole	参与人代码角色	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元	1=交易单元
	448	PartyID	参与人代码	融出方证券账户	融出方证券账户	融出方证券账户	融出方证券账户	融出方证券账户
	447	PartyIDSource	参与人代码源	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	5=中国投资者编号	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	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户	5=投资者证券账户
组件结束								
组件结束								
31	LastPx		价格	年化利率, 单位为百分比, 小数点后两位, 须大于等于-99.9900 且小于等于 99.9900	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000	填 0.0000
32	LastQty		数量	标的证券数量	部分购回: 购回标的的证券的数量 其他购回方式: 填 0.00	标的证券数量	标的证券数量	填 0.00
152	CashOrderQty		现金金额	初始交易金额	终止购回: 填 0.0000 其他购回方式: 购回交易金额	不需要填写	解除红利金额	不需要填写
8908	ShareProperty		股份性质	股份性质	部分购回: 购回标的的证券的股份性质	股份性质	股份性质	不需要填写

				其他购回方式：不需要填写			
541	MaturityDate	购回交易日	购回交易日	购回交易日	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10183	PledgeeType	质权人类型	质权人类型	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10182	OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	不需要填写	部分购回：需购回的初始交易或补充质押的客户成交申报编号 其他购回方式：初始交易客户成交申报编号	初始交易客户成交申报编号	需解除质押的初始交易或补充质押的客户成交申报编号	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	部分购回：需购回的初始交易或补充质押的交易日期 其他购回方式：初始交易日期	初始交易日期	需解除质押的初始交易或补充质押的成交申报日期	初始交易日期
10190	InvestmentType	资金用途类型	01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写

10191	AlertRatio	预警线，单位为百分比	预警线	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写
10192	SettlementRatio	平仓线，单位为百分比	平仓线	不需要填写	不需要填写	不需要填写	不需要填写

说明：字段取值参见 Binary 接口说明部分。

3.3 委托申报样例

某证券公司指定的股票质押回购申报交易单元为 008888，其资产管理子公司的集合资产管理计划产品作为融出方，融出方交易单元为 006666，融出方证券账户为 0877777777，20130307 日与融入方（融入方交易单元为 009999，融入方证券账户为 0005555555）达成一笔初始交易，将 110 万股 002222 证券的首发后个人类限售股作为融资质押标的证券，融资金额 100 万，约定 20150306 日到期购回，购回交易金额 120 万，客户订单编号为“A0000001”，资金用途类型为生产经营，预警线为 150%，平仓线为 130%，年化利率为 15.12%。

20131111 日，融出方与融入方达成协议，补充质押 50 万股 303333 证券的首发前个人类限售股作为融资质押标的证券，客户订单编号为“A0000002”。20131120 日，质押的 50 万股 303333 证券变更为无限售流通股。

20131202 日，303333 证券现金分红，每股派现金 1 元。20131212 日，融出方与融入方达成协议，部分解除质押 10 万股 303333 证券及其 50 万元现金红利，客户订单编号为“A0000003”。

20140708 日，融出方与融入方达成协议，部分购回 1 股 303333 证券，部分还款 30 万元，客户订单编号为“A0000007”。

20150306 日，约定到期购回日融入方资金不足无法购回，融出方与融入方达成协议进行违约处置，客户订单编号为“A0000005”。

20150309 日，融入方资金充足计划重新购回质押标的，融出方与融入方达成协议进行违约处置撤销，客户订单编号为“A0000006”。

20150323 日，融出方与融入方达成协议，延期至 20150906 日购回，延期购回交易金额 95 万(其中 5 万是延期购回产生的利息)，客户订单编号为“A0000004”。

3.3.1 Binary 消息示例

表 3-3 申报 BINARY 消息示例

域名	20130307 日申报 初始交易	20131111 日申报 补充质押	20131212 日申报 部分解除质押	20140708 日申报部分 购回	20150306 日申报违约 处置	20150309 日申报违约 处置撤销	20150906 日申报 购回交易
MsgType	100903	100903	100903	100903	100903	100903	100903
ApplID	090	090	090	090	090	090	090
SubmittingPBUID	008888	008888	008888	008888	008888	008888	008888
SecurityID	002222	303333	303333	303333	全空格	全空格	
SecurityIDSource	102	102	102	102	102	102	102
OwnerType	102	102	102	102	102	102	102
ClearingFirm	01	01	01	01	01	01	01
TransactTime	20130307-14:42:13:555	20131111-14:42:13:555	20131212-14:42:13:555	20140708-14:42:13:555	20150306-14:42:13:555	20150309-14:42:13:555	20150906-14:42:13:555
UserInfo	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
TradeReportID	A0000001	A0000002	A0000003	A0000007	A0000005	A0000006	A0000004
TradeReportType	0	0	0	0	0	0	0
TradeReportTransType	0	0	0	0	0	0	0
TradeHandlingInstr	1	1	1	1	1	1	1
TradeReportRefID	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
LastPx	15.1200	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
LastQty	1100000.00	500000.00	100000.00	1.00	0.00	0.00	0.00
TrdType	1001	1006	1007	1009	1008	1010	1004
TrdSubType	0	0	0	0	0	0	0

ConfirmID	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
Side	2	2	2	2	2	2	2
PBUID	009999	009999	009999	009999	009999	009999	009999
AccountID	0005555555	0005555555	0005555555	0005555555	0005555555	0005555555	0005555555
BranchID	BB	BB	BB	BB	BB	BB	BB
CounterpartyPBUID	006666	006666	006666	006666	006666	006666	006666
CounterpartyAccountID	0877777777	0877777777	0877777777	0877777777	0877777777	0877777777	0877777777
CounterpartyBranchID	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
CashOrderQty	1000000.0000	0.0000	500000.0000	300000.00	0.0000	0.0000	950000.0000
ShareProperty	01	05	00	00	全空格	全空格	全空格
MaturityDate	20150306	0	0	20150306	0	0	20150306
PledgeeType	3	0	0	0	0	0	0
OrigTradeID	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
OrigSubmittingPBUID	全空格	008888	008888	008888	008888	008888	008888
OrigTradeReportID	全空格	A0000001	A0000002	A0000002	A0000001	A0000001	A0000001
OrigTradeDate	0	20130307	20131111	20131111	20130307	20130307	20130307
InvestmentType	01	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格	全空格
AlertRatio	150.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SettlementRatio	130.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00

3.3.2 STEP 消息示例

20130307 日申报初始交易：

1180=090<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>828=1001<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20130307-14:42:13:555<SOH>48=002222<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=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=15.1200<SOH>32=1100000.00<SOH>152=1000000.0000<SOH>8908=01<SOH>541=20150306<SOH>10183=3<SOH>10190=01<SOH>10191=150.00<SOH>10192=130.00<SOH>

20131111 日申报补充质押：

1180=090<SOH>571=A0000002<SOH>522=102<SOH>828=1006<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20131111-14:42:13:555<SOH>48=303333<SOH>22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000<SOH>32=500000.00<SOH>8908=05<SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20130307<SOH>

20131212 日申报部分解除质押：

1180=090<SOH>571=A0000003<SOH>522=102<SOH>828=1007<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20131212-14:42:13:555<SOH>48=303333<SOH>

22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117
=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH>1119=4
<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<SOH>452
=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH>447=D
<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>
452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000<SOH>3
2=100000.00<SOH>152=500000.0000<SOH>8908=00<SOH>10182=A0000002<SOH
>1125=20131111<SOH>

20140708 日申报部分购回

1180=090<SOH>571=A0000007<SOH>522=102<SOH>828=1009<SOH>856=0<SO
H>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20140708-14:42:13:555<SOH>48=303333<SOH>
22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117
=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH>1119=4
<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<SOH>452
=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH>447=D
<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=C<SOH>
452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000<SOH>3
2=1.00<SOH>152=300000.0000<SOH>8908=00<SOH>541=20150306<SOH>10182=
A0000002<SOH>1125=20131111<SOH>

20150306 日申报违约处置

1180=090<SOH>571=A0000005<SOH>522=102<SOH>828=1008<SOH>856=0<SO
H>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20150306-14:42:13:555<SOH>48=
<SOH>22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SO
H>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH
>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<S
OH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH
>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=

C<SOH>452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000
<SOH>32=0.00 <SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20130307<SOH>

20150309 日申报违约处置撤销

1180=090<SOH>571=A0000006<SOH>522=102<SOH>828=1010<SOH>856=0<SO
H>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20150309-14:42:13:555<SOH>48=
<SOH>22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SO
H>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH
>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<S
OH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH
>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=
C<SOH>452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000
<SOH>32=0.00 <SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20130307<SOH>

20150906 日申报购回交易

1180=090<SOH>571=A0000004<SOH>522=102<SOH>828=1004<SOH>856=0<SO
H>487=0<SOH>1123=1<SOH>60=20150906-14:42:13:555<SOH>48=
<SOH>22=102<SOH>1116=3<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SO
H>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=13<SOH>1117=01<SOH>1118=F<SOH
>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=009999<SOH>447=C<S
OH>452=1<SOH>448=0005555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=BB<SOH
>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=1<SOH>453=2<SOH>448=006666<SOH>447=
C<SOH>452=1<SOH>448=0877777777<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>31=0.0000
<SOH>32=0.00<SOH>152=950000.0000<SOH>541=20150306
<SOH>10182=A0000001<SOH>1125=20130307<SOH>

四、 成交申报响应

对于股票质押式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	购回交易	补充质押	部分解除质押	违约处置、违约处置 撤销
Standard Header	消息头 MsgType=200904					
ReportIndex	回报记录号					
ApplID	应用标识	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购	090=股票质押式回购
ReportingPBUID	回报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托申 报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托申 报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元	股票质押式回购委托 申报交易单元
SecurityID	证券代码	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托申 报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托申 报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托申 报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值
ClearingFirm	结算机构代码	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托申 报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 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	成交申报响应生成时 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	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	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
TradeReportType	成交申报类型	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
TradeReportTransType	成交申报事务类别	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
TradeHandlingInstr	成交申报模式	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式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	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	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	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	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	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值

LastQty	数量	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
TrdType	成交申报业务类别	1001=股票质押式回购初始交易	1002=股票质押式回购提前购回 1003=股票质押式回购到期购回 1004=股票质押式回购延期购回 1005=股票质押式回购终止购回 1009=股票质押式回购部分购回	1006=股票质押式回购补充质押	1007=股票质押式回购部分解除质押	1008=股票质押式回购违约处置 1010=股票质押式回购违约处置撤销
TrdSubType	成交申报业务子类 预留	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
ConfirmID	约定号	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式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	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
PBUID	本方交易单元	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
AccountID	本方证券账户	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
BranchID	本方营业部代码	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值

CounterpartyPBUID	对手方交易单元	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
CashOrderQty	现金金额	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
ShareProperty	股份性质	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
MaturityDate	购回交易日	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
PledgeeType	质权人类型	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式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	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
OrigSubmittingPBUID	初始交易申报交易单元	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
OrigTradeDate	初始交易成交申报日期	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
InvestmentType	资金用途类型	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
AlertRatio	预警线	股票质押式回购委托	股票质押式回购委托申	股票质押式回购委托	股票质押式回购委托	股票质押式回购委托

		申报对应字段值	报对应字段值	申报对应字段值	申报对应字段值	申报对应字段值
SettlementRatio	平仓线	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托申 报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 申报对应字段值	股票质押式回购委托 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	购回交易	补充质押	部分解除质押	违约处置、违约处 置撤销
	MessageHeader	MsgType=AR					
10179	ReportIndex	回报记录号					
1180	ApplID	应用标识	090=股票质押式回 购	090=股票质押式回 购	090=股票质押式回 购	090=股票质押式回 购	090=股票质押式回 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	客户订单编号	客户订单编号	客户订单编号
522	OwnerType	成交申报所有者类型	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值
828	TrdType	成交申报业务类别	1001=股票质押式	1002=股票质押式	1006=股票质押式	1007=股票质押式	1008=股票质押式回

			回购初始交易	回购提前购回 1003=股票质押式 回购到期购回 1004=股票质押式 回购延期购回 1005=股票质押式 回购终止购回 1009=股票质押式 回购部分购回	回购补充质押	回购部分解除质押	购违约处置 1010=股票质押式回 购违约处置撤销
856	TradeReportType	成交申报类型	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值
487	TradeReportTransType	成交申报事务类别	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值
1123	TradeHandlingInstr	成交申报模式	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值	股票质押式回购委 托申报对应字段值
8912	TrdAckStatus	成交申报响应状态	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	0=Accepted, 接受 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	0=Accepted, 接受 1=Rejected, 拒绝	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	成交申报响应生成	成交申报响应生成	成交申报响应生成	成交申报响应生成时

			时间	时间	时间	时间	间
组件<Instrument>							
48	SecurityID	证券代码	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
22	SecurityIDSource	证券代码源	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
组件结束							
组件<RootParties>							
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
→	1117	RootPartyID	参与人代码	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
组件结束							
组件<TrdCapRptSideGrp>							
552	NoSides	side 个数	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
→	54	Side	买卖方向	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值

组件<Parties>								
453	NoPartyIDs	参与人代码个数	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
→	448	PartyID	参与人代码	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
	447	PartyIDSource	参与人代码源	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
	452	PartyRole	参与人代码角色	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
组件结束								
组件结束								
17	ExecID	执行编号						
31	LastPx	成交价格	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
32	LastQty	成交数量	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
152	CashOrderQty	现金金额	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
8908	ShareProperty	股份性质	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
541	MaturityDate	购回交易日	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
10183	PledgeeType	质权人类型	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式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	全空格	全空格	全空格
10182	OrigTradeReportID	初始交易客户成交申报编号	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
1125	OrigTradeDate	初始交易成交申报日期	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
10190	InvestmentType	资金用途类型	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
10191	AlertRatio	预警线, 单位为百分比	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值
10192	SettlementRatio	平仓线, 单位为百分比	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值	股票质押式回购委托申报对应字段值

说明:

(1) 字段取值参见 Binary 接口说明部分。

五、 清算和交收

参见附件二、股票质押回购业务的结算数据接口修订说明。

六、 业务数据报送

为满足本所对股票质押回购业务监管的需要，开展股票质押回购业务的券商应当向深交所报送相关业务报表。股票质押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、股票质押回购业务数据报送指南。

七、 开展股票质押回购业务的券商系统注意事项

7.1 行情相关说明

股票质押回购标的证券基本资料已在证券信息 securities.xml 中挂牌，但标的证券发生配股等权益处理时证券公司向融入方返还的配股权证等证券代码可能未在深交所交易系统挂牌；股票质押回购成交行情等信息不会反映到实时行情信息中。

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 关于客户委托服务渠道

建议证券公司根据该类业务的目标客户及业务风险属性，自行调整其柜台委托、网上交易、自助委托、电话委托等客户委托渠道（可选择一种或多种渠道）中的相应前端系统，以支持股票质押回购业务的委托指令录入。

7.4 关于券商柜台系统

◇ 向深交所申报各类委托前的风险前端控制

所有申报的数量、价格或金额等要素必须符合本所股票质押回购交易相关业务规则。

证券公司应当实施相应的融入方、融出方适当性管理，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融入方、融出方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融入方、融出方

委托。

证券公司应当对融入方、融出方（包括证券公司自己的相应账户）实施股份与资金前端监控，其大致处理逻辑可参考如下（未考虑税费因素）：

业务情形	融入方证券账户	融入方资金账户	融出方资金账户
初始交易委托申报前	记减股份	N/A	记减资金，初始交易金额
购回交易委托申报前	N/A	记减资金，购回交易金额	N/A
补充质押委托申报前	记减股份	N/A	N/A
部分解除质押委托申报前	N/A	N/A	N/A
初始交易自动撤单后	记加股份	N/A	记加资金，初始交易金额
购回交易自动撤单后	N/A	记加资金，购回交易金额	N/A
补充质押自动撤单后	记加股份	N/A	N/A
部分解除质押自动撤单后	N/A	N/A	N/A

◇ 向交易系统申报委托

接受融入方、融出方股票质押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权部门的审批额度，控制其业务规模，避免业务风险。

◇ 质押特别交易单元不得用于除违约处置外的证券交易

证券公司应当严格管理质押特别交易单元不得用于除违约处置外的证券交易。

八、 联系方式

业务：0755-88668883（交易）

0755-21899261（结算）

技术：0755-88668679（交易）

Email: ssegcb@szse.cn

0755-25946080（结算）

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

0755-88668192（业务数据报送）

附件一、股票质押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股票质押式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
20001	无效账户	股票质押式回购初始交易的融入方或融出方证券账户为未开户账户
20002	无效账户	股票质押式回购初始交易的融入方或融出方证券账户是一个无效账户(已注销、挂失等等)
20005	业务禁止	标的证券无股票质押式回购初始交易权限
20010	数量非法	委托数量不是数量单位的整数倍(仅适用于深交所上市交易的证券)
20025	无效单元	股票质押式回购委托的申报交易单元无股票质押式回购业务的交易权限; 股票质押式回购委托融入方交易单元、融出方交易单元与申报交易单元不属于同一会员
20026	无效单元	信用账户必须通过信用交易单元申报; 非信用账户必须通过非信用交易单元申报
20027	无效单元	QFII 账户未从指定交易单元申报
20034	金额非法	股票质押式回购初始交易、购回交易、部分解除质押交易的委托金额不为 0.01 元的整数倍

20047	规模超限	股票质押式回购初始交易委托申报超出报备的业务规模
20055	无效会员	会员无股票质押式回购初始交易权限
20068	结算机构错	股票质押式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
20070	无效账户	股票质押式回购委托中的融入方证券账户在融入方交易单元上为不合格账户，或融出方证券账户在融出方交易单元上为不合格账户
20099	重单	重单

附件二、股票质押回购业务的结算数据接口修订说明

1、接口修订简要说明

对深交所质押式回购业务的相关成交指令，中国结算深圳分公司采用 T+0 逐笔全额非担保交收方式进行处理。

通过 SJSMX0.DBF 和 SJSJG.DBF 分别发送质押回购业务指令的逐笔清算和交收结果。现有 ‘GZCS’（初始交易）、‘GZBC’（补充质押）、‘GZBF’（部分解除质押）、‘GZDQ’（购回交易）、‘GZ06’（违约处置）、‘GZ05’（部分购回）、‘GZ07’（撤销违约处置）七种业务类别；购回交易只需一笔指令 ‘GZDQ’，结算系统自动进行购回交易资金清算与股份解除质押，一笔 ‘GZDQ’（购回交易）指令将会对应一笔 ‘GZDQ’（购回交易）与多笔 ‘GZBF’（部分解除质押），其中 ‘GZDQ’ 主要是对应资金的清算交收结果，‘GZBF’ 主要是对应解除质押的股份处理结果；参与者申报一笔违约处置 ‘GZ06’ 或撤销违约处置 ‘GZ07’ 交易，结算系统会反馈一条 ‘GZ06’ 或 ‘GZ07’ 数据用于对该笔委托进行确认。若该笔委托处理成功，则同时反馈多条 ‘GZ06’ / ‘GZ07’ 数据对应质押券的转托管处理结果。

新增 SJSJG.DBF 中业务类别为 ‘GZ90’ 的数据记录发送未了结股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系。

具体请参见下文 SJSMX0.DBF、SJSJG.DBF 接口中的定义和实例说明。

融入方可用于股票质押式回购融资的股份性质包括：

股份性质	性质说明
00	无限售流通股
01	首发后限售股
05	首发前限售股

通过 SJSZJ.DBF 发送相关资金交收数据。SJSZJ.DBF 中股票质押式回购相关的资金金额分别通过产生该资金的业务类别表示。例如补充质押产生的质押登记费，在 SJSZJ.DBF 中的业务类别为 ‘GZBC’。

本业务在进行股份质押登记时，将股份在客户原托管单元进行冻结；在进行股份解押登记时，将股份在客户原托管单元进行解冻；在进行违约处置时，对应初始交易合同与相应补充质押下的所有质押股份（司法再冻结部分除外）将被转托管至券商特别质押交易单元上并调整为可售冻结，现金红利划入券商

自营备付金账户；在进行撤销违约处置时，对应初始交易合同与相应补充质押在特别质押交易单元下的所有质押股份（司法再冻结部分除外）将被转托管回客户原托管单元上并调整为不可售冻结。以下为涉及质押冻结的接口说明。

使用 SJSJG.DBF 中业务类别为 ‘DJBG’、‘DJJX’ 的数据记录表示质押回购业务中涉及的股份和资金的冻结和解冻。业务类别为 ‘DJ00’ 的数据记录中也包含质押冻结的数量。具体请参见下文 SJSJG.DBF 接口定义。

通过 SJSFW.DBF 中业务类别为 ‘11’ 的数据记录发送股票质押式回购质押冻结明细信息。取消数据类别 ‘XD’ 限售股份冻结股数的数据记录发送，该部分数据体现在 SJSJG.DBF 中业务类别为 ‘DJ00’ 的数据记录中。具体请参见下文 SJSFW.DBF 接口定义。

2、清算明细库 SJSMX0.DBF

用于质押式回购的初始交易、补充质押、解除质押、购回交易、违约处置、部分购回和撤销违约处置指令，全部采用 T+0 逐笔全额非担保交收。对于初始交易、补充质押，清算交收数据中同时涉及到证券和资金；对于解除质押，当不涉及解除冻结分红派息资金的质押时，清算交收数据中只涉及证券，不涉及资金，当涉及解除冻结分红派息资金的质押时，将会涉及分红派息资金的解押；对于购回交易，清算交收数据将只涉及资金（终止购回时资金为零），证券交收数据体现在结算系统自动进行的部分解除质押交收指令中。对于违约处置，清算交收数据中将不涉及证券资金，股份解除质押冻结相关数据将通过目前解冻相关接口下发。具体请参见下表：

SJSMX0.DBF 的数据填写说明如下：

字段名	业务类别						
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (部分解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06 (违约处置)	GZ07 (撤销违约处置)
MXJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	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	备付金账户	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'
MXYWLB	'GZCS'	'GZBC'	'GZBF'	'GZDQ'	'GZ05'	'GZ06'	'GZ07'
MXZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	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	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	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	证券账户	证券账户	证券账户
MXDBBH	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号
MXYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码	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	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	业务流水号	业务流水号	业务流水号
MXCJSL	成交数量 MXTGDY 为出资单 元时>0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	成交数量 MXTGDY 为出资单 元时>0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	成交数量 MXTGDY 为出资单 元时<=0; MXTGDY 为融资单 元时>=0;	0	成交数量 MXTGDY 为出资单 元时<=0; MXTGDY 为融资单 元时>=0;	0	0

字段名	业务类别						
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (部分解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06 (违约处置)	GZ07 (撤销违约处置)
MXQSSL	清算数量 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	清算数量 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	清算数量 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时>=0;	0	清算数量 MXTGDY 为出资单元 时=0; MXTGDY 为融资单元 时>=0;	0	0
MXCJYG							
MXQSJG							
MXXYJY							
MXPCBS							
MXZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	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	证券子类别	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质		股份性质		
MXJSFS	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’	‘N’
MXHBDH	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号
MXQSBJ	融资资金 MXTGDY 为出资单 元时<0; MXTGDY 为融资单 元时>0;			购回资金 MXTGDY 为出资单元 时>=0; MXTGDY 为融资单元 时<=0;	购回资金 MXTGDY 为出资单元 时>=0; MXTGDY 为融资单元 时<=0;		
MXYHS							

字段名	业务类别						
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (部分解除 质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06 (违约处置)	GZ07 (撤销违约处 置)
MXJYJSF	交易所经手费 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时<0;				0	0	0
MXJGGF							
MXGHF							
MXJSF							
MXSXF							
MXQSYJ							
MXQTFY	质押登记费 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	质押登记费 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时<0;	解押红利 MXTGDY 为出资单 元时=0; MXTGDY 为融资单 元时>=0;				
MXZJJE							
MXSFJE	收付净额	收付净额	收付净额	收付净额	收付净额	0	0
MXCJRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXJSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
MXFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日

字段名	业务类别						
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (部分解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06 (违约处置)	GZ07 (撤销违约处置)
MXQTRQ	到期日期						
MXSCDM							
MXJYFS	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'
MXZQDM2							
MXTGDY2							
MXDDBH2							
MXCWDH	错误代号	错误代号	错误代号	错误代号	错误代号	错误代号	错误代号
MXPPHM							
MXFJSM	01-24位:初始交易合同序号	01-24位:补充质押对应的初始交易合同序号	01-24位:部分解除质押对应的初始交易合同序号	01-24位:初始交易合同序号	01-24位:部分购回对应的初始交易合同序号	01-24位:违约处置对应的初始交易合同序号	01-24位:撤销违约处置对应的初始交易合同序号
MXBYBZ							

3、交收明细结果库 SJSJG.DBF

对于 SJSMX0.DBF 中 ‘GZCS’ (初始交易)、‘GZBC’ (补充质押)、‘GZBF’ (部分解除质押)、‘GZDQ’ (购回交易)、‘GZ06’ (违约处置)、‘GZ05’ (部分购回)、‘GZ07’ (撤销违约处置) 业务, 采用 T+0 逐笔全额非担保交收方式, 交收结果 T 日体现在 SJSJG.DBF 中。

股票质押式回购初始交易未购回期间, 每日通过 SJSJG.DBF 中业务类别为 ‘GZ90’ 的数据记录发送股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系。

申报要素合法性检查不通过的申报指令的交收结果, JGZYDH 字段值为相应错误原因代码, JGQSSL 字段值为 0, JGJSSL 字段值为 0, JGJSBZ 字段值为 ‘N’。

主要的错误代码及错误描述如下表所示:

错误代号	错误描述
E81	无效的融入股东
E82	无效的融出股东
E83	非法的融入席位
E84	非法的融出席位
E85	报单单元找不到对应的质押席位
E86	融入席位、融出席位和质押席位不属于同一参与者
E87	质权人类别与融出方股东代码不匹配
E8A	质权人类别错误
E8B	质押合同序号重复
E8C	初始质押或补充质押合同不存在
E8D	融入股东不一致
E8E	融入席位不一致
E8F	融出股东不一致
E8G	质押席位不一致
E8H	初始交易合同不存在或已购回
E8N	质押上司法再冻结时解押委托股数错
E8P	解押委托资金不等于冻结股息
D34	委托数量小于零
D1A	成交金额小于零
D35	可质押 / 解押股数小于委托股数
N22	初始交易时委托资金小于等于 0
N23	股份未上市
N24	因司法再冻结, 无可供处置或可供撤销处置的股份
N39	未报备特别质押交易单元
N45	委托数量和金额同时为 0

如想获取最新的错误原因代码，可以通过 D-COM 下载 SJSGB.DBF，取广播类别是‘ZY’的数据。

SJSJG.DBF 相关字段的数据填写说明参见下表。

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGJSZH	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	结算账号	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	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	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'01'	'02'
JGYWLB	'GZCS'	'GZBC'	'GZBF'	'GZDQ'	'GZ05'	'GZ06'	'GZ06'	'GZ07'	'GZ07'	'GZ90'
JGZQDM	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	证券代码	
JGJYDY	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	交易单元	
JGTGDY	托管单元	托管单元	托管单元	托管单元	结算参与人托管单元	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	证券账户	证券账户	证券账户	证券账户	
JGDDBH	交易合同序号 (左对齐右补空格)	交易合同序号 (左对齐右补空格)	交易合同序号 (左对齐右补空格)	交易合同序号 (左对齐右补空格)	交易合同序号 (左对齐右补空格)	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	交易合同序号	初始交易合同序号, 左对齐
JGYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码 或 空	营业部代码	营业部代码	营业部代码 或 空	空	营业部代码 或 空	空	
JGZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号	

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGYWLSH	业务流水号	业务流水号	业务流水号或空	业务流水号	业务流水号	业务流水号或空	空	业务流水号或空	空	
JGCJSL	JGTGDY 为出资单元时>0 JGTGDY 为融资单元时<0	JGTGDY 为出资单元时>0 JGTGDY 为融资单元时<0	JGTGDY 为出资单元时<=0 JGTGDY 为融资单元时>=0	0	JGTGDY 为出资单元时<=0; JGTGDY 为融资单元时>=0	0	0	0	0	
JGQSSL	JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0	JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0	JGTGDY 为出资单元时 =0 JGTGDY 为融资单元时>=0	0	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时>=0;	0	0	0	0	
JGJSSL	JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0, 表示质押冻结股数若检查失败, 该字段填 0	JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0, 表示质押冻结股数若检查失败, 该字段填 0	JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时>=0, 表示解冻股数若检查失败, 该字段填 0	0	JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时>=0, 表示解冻股数检查失败的记录, 该字段填写 0	0	JGTGDY 为融资单元时<0 JGTGDY 为违约处置专用单元时>0	0	JGTGDY 为融资单元时>0 JGTGDY 为违约处置专用单元时<0	
JGCJJG										
JGQSJG										

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGXYJY										
JGPCBS										
JGZQLB	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别	证券类别					
JGZQZL					证券子类别					
JGGFXZ	股份性质	股份性质	股份性质		股份性质		股份性质		股份性质	
JGLTLX	流通类型	流通类型	流通类型		流通类型		流通类型		流通类型	
JGJSFS	'N'	'N'	'N'	'N'	'N'	'N'	'N'	'N'	'N'	
JGHBDS	货币代号	货币代号	货币代号	货币代号	'RMB'	'RMB'	'RMB'	'RMB'	'RMB'	
JGQSB	融资资金 JGTGDY 为出资单元时<0 JGTGDY 为融资单元时>0			购回资金 JGTGDY 为出资单元时>=0 JGTGDY 为融资单元时<=0	购回资金 JGTGDY 为出资单元时 >=0; JGTGDY 为融资单元时 <=0;					
JGYHS										
JGJYJS F	交易所经手费 JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时<0;									

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGJGGF										
JGGHF										
JGJSF										
JGSXF										
JGQSYJ										
JGQTFY	质押登记费 JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0	质押登记费 JGTGDY 为出资单元时=0 JGTGDY 为融资单元时<0								
JGZJJE			解押红利 JGTGDY 为出资单元时=0; JGTGDY 为融资单元时>=0							
JGSFJE	收付净额	收付净额	收付净额	收付净额	收付净额	0	0	0	0	
JGJSBZ	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’	‘Y’ 或 ‘N’	‘Y’	‘Y’

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGZYDH	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号	摘要代号	若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号		若 JGJSBZ 为 'N', 则是错误代号		
JGCJRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	
JGQSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	
JGJSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	
JGFSRQ	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日	T 日
JGQTRQ	到期日期									
JGSCDM										
JGJYFS	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	'02'	
JGZQDM 2										
JGTGDY 2										
JGDBBH 2										

字段名	业务类别									
	GZCS (初始交易)	GZBC (补充质押)	GZBF (解除质押)	GZDQ (购回交易)	GZ05 (部分购回)	GZ06(违约处置—委托确认)	GZ06(违约处置—转托管明细)	GZ07 (撤销违约处置—委托确认)	GZ07 (撤销违约处置—转托管明细)	GZ90(股票质押式回购初始交易及补充质押合同序号对应关系)
JGFJSM	01-24 位: 初始交易合同序号 51-74 位: 冻结序号	01-24 位: 补充质押对应的初始交易合同序号 25-48 位: 补充质押合同序号 51-74 位: 冻结序号	01-24 位: 部分解除质押对应的初始交易合同序号 25-48 位: 部分解除质押对应的质押合同序号 51-74 位: 冻结序号	01-24 位: 初始交易合同序号	01-24 位: 部分购回对应的初始交易合同序号 25-48 位: 部分购回对应的质押合同序号 51-74 位: 冻结序号	01-24 位: 初始交易合同序号	01-24 位: 初始交易合同序号 25-48 位: 对应的初始交易或补充质押合同序号	01-24 位: 初始交易合同序号	01-24 位: 初始交易合同序号 25-48 位: 对应的初始交易或补充质押合同序号	1-24 位为补充质押合同序号 (或 初始交易合同序号), 左对齐, 右补空格
JGBYZ										

下面是对 SJSJG.DBF 接口的实例化说明，按业务类别描述了针对融资方交易单元、出资方交易单元的接口数据记录。SJSMX0.DBF 可对照参考该实例。

该实例中出资方（交易/托管单元 009999、证券账户 0899999999）通过证券公司（报单交易单元 008888、对应质押专用交易/托管单元 728888）与融资方（交易/托管单元 006666、证券账户 0066666666）进行交易。

【实例 1】 初始交易：2012-08-22 日，达成初始交易（证券代号 000001，股份性质 ‘00’，质押股数 200000 股、融资金额 500000 元），初始交易的合同序号为 00888820120822A9000001，拟购回日期 2012-12-31。初始交易经手费按每笔 100 元，质押登记手续费按面值的千分之一向融资方收取。

字段名	‘GZCS’ 初始交易	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘GZCS’	‘GZCS’
JGZQDM	‘000001’	‘000001’
JGJYXW	‘009999’	‘006666’
JGTGDY	‘009999’	‘006666’
JGZQZH	‘0899999999’	‘0066666666’
JGDDBH	‘00888820120822A9000001’	‘00888820120822A9000001’
JGZXBH	‘090000001’	‘090000001’
JGYWLSH		
JGCJSL	200000	-200000
JGQSSL	0	-200000
JGJSSL	0	-200000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	‘00’	‘00’
JGZQZL		
JGAFXZ	‘00’	‘00’
JGLTLX	‘0’	‘0’
JGJSFS	‘N’	‘N’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ	-500000	500000

字段名	'GZCS' 初始交易	
	出资方单元	融资方单元
JGYHS		
JGJYJSF		-100
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		-200
JGZJJE		
JGSFJE	-500000	499700
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-08-22	2012-08-22
JGQSRQ	2012-08-22	2012-08-22
JGJSRQ	2012-08-22	2012-08-22
JGFSRQ	2012-08-22	2012-08-22
JGQTRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空 51-74 位: 00888820120822A9000001	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空 51-74 位: 00888820120822A9000001
JGBYBZ		

【实例 2】 补充质押：2012-09-12 日，在实例 1 的基础上进行了补充质押（证券代号 000002，股份性质 '05'，质押股数 50000 股），补充质押的合同序号为 00888820120912A9000088。质押登记手续费按面值的千分之一向融资方收取。

字段名	'GZBC' 补充质押	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZBC'	'GZBC'
JGZQDM	'000002'	'000002'

字段名	'GZBC' 补充质押	
	出资方单元	融资方单元
JGJYXW	'009999'	'006666'
JGTGDY	'009999'	'006666'
JGZQZH	'0899999999'	'0066666666'
JGDDBH	'00888820120912A9000088'	'00888820120912A9000088'
JGZXBH	'090000002'	'090000002'
JGYWLSH		
JGCJSL	50000	-50000
JGQSSL	0	-50000
JGJSSL	0	-50000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	'00'	'00'
JGZQZL		
JGGFXZ	'05'	'05'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBDH		'RMB'
JGQSBJ		
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		-50
JGZJJE		
JGSFJE		-50
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-09-12	2012-09-12
JGQSRQ	2012-09-12	2012-09-12
JGJSRQ	2012-09-12	2012-09-12
JGFSRQ	2012-09-12	2012-09-12
JGQTRQ		
JGSCDM		

字段名	‘GZBC’ 补充质押	
	出资方单元	融资方单元
JGJYFS	‘02’	‘02’
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24 位: 00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088 51-74 位: 00888820120912A9000088	01-24 位: 00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088 51-74 位: 00888820120912A9000088
JGBYBZ		

【实例 3】解除质押：2012-10-29 日，进行了部分解除质押（证券代号 000001，解押股数 200000 股，同时这 200000 股在质押期间发生了分红派息，派发了 80000 元并被质押，部分解除质押申报同时申请了对这 80000 元红利的解押）；

字段名	‘GZBF’ 部分解除质押	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘GZBF’	‘GZBF’
JGZQDM	‘000001’	‘000001’
JGJYXW	‘009999’	‘006666’
JGTGDY	‘009999’	‘006666’
JGZQZH	‘0899999999’	‘0066666666’
JGDDBH	‘00888820121029A9000007’	‘00888820121029A9000007’
JGZXBH	‘090000003’	‘090000003’
JGYWLSH		
JGCJSL	-200000	200000
JGQSSL	0	200000
JGJSSL	0	200000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	‘00’	‘00’
JGZQZL		
JGAFXZ	‘00’	‘00’
JGLTLX	‘0’	‘0’
JGJSFS	‘N’	‘N’

字段名	‘GZBF’部分解除质押	
	出资方单元	融资方单元
JGHBDH		
JGQSBJ	0	
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE	0	80000
JGSFJE	0	80000
JGJSBZ	‘Y’	‘Y’
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-10-29	2012-10-29
JGQSRQ	2012-10-29	2012-10-29
JGJSRQ	2012-10-29	2012-10-29
JGFSRQ	2012-10-29	2012-10-29
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	‘02’	‘02’
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120822A9000001 51-74 位: 00888820120822A9000001	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120822A9000001 51-74 位: 00888820120822A9000001
JGBYBZ		

特别说明： 对于某笔冻结（同一个冻结序号）的部分解除质押：券商可以只申报部分股份或全部股份的解押，也可以只申报部分孳息或全部孳息的解押，也可以同时申报股份和孳息的解押。股份和孳息只在券商申报的情况下才做解押。

【实例 4】购回交易：2012-12-31 日，对初始交易进行购回交易（购回金额 520000 元）；

字段名	‘GZDQ’ 购回交易	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘GZDQ’	‘GZDQ’
JGZQDM	‘000001’	‘000001’
JGJYXW	‘009999’	‘006666’
JGTGDY	‘009999’	‘006666’
JGZQZH	‘0899999999’	‘0066666666’
JGDDBH	‘00888820121231A9000009’	‘00888820121231A9000009’
JGZXBH	‘090000004’	‘090000004’
JGYWLSH		
JGCJSL	0	0
JGQSSL	0	0
JGJSSL	0	0
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	‘00’	‘00’
JGZQZL		
JGGFXZ		
JGLTLX		
JGJSFS	‘N’	‘N’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’
JGQSBJ	520000	-520000
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	520000	-520000
JGJSBZ	‘Y’	‘Y’

字段名	'GZDQ' 购回交易	
	出资方单元	融资方单元
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGJSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGFSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空 51-74 位: 空	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空 51-74 位: 空
JGBYBZ		

同时，结算系统将自动对业务留存的质押物进行解除质押（证券代号 000002，股份性质 '05'，解押股数 50000 股，同时包括质押期间产生的分红派息 5000 元）

字段名	'GZBF' 部分解除质押	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZBF'	'GZBF'
JGZQDM	'000002'	'000002'
JGJYXW	'009999'	'006666'
JGTGDY	'009999'	'006666'
JGZQZH	'0899999999'	'0066666666'
JGDBH	'00888820121231A9000009'	'00888820121231A9000009'
JGZXBH	'090000004'	'090000004'
JGYWLSH		
JGCJSL	-50000	50000
JGQSSL	0	50000
JGJSSL	0	50000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		

字段名	'GZBF' 部分解除质押	
	出资方单元	融资方单元
JGPCBS		
JGZQLB	'00'	'00'
JGZQZL		
JGGFXZ	'05'	'05'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS		
JGHBDH		
JGQSBJ		
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		5000
JGSFJE		5000
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGJSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGFSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088 51-74 位: 00888820120912A9000088	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088 51-74 位: 00888820120912A9000088
JGBYBZ		

【实例 5】 违约处置：2012-12-31 日，若未进行购回交易，而是申报了违约处置；

字段名	'GZ06' 违约处置-委托确认	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZ06'	'GZ06'
JGZQDM	'000001'	'000001'
JGJYXW	'009999'	'006666'
JGTGDY	'009999'	'006666'
JGZQZH	'0899999999'	'0066666666'
JGDDBH	'00888820121231A9000009'	'00888820121231A9000009'
JGZXBH	'090000005'	'090000005'
JGYWLSH		
JGCJSL	0	0
JGQSSL	0	0
JGJSSL	0	0
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	'00'	'00'
JGZQZL		
JGGFXZ	'00'	'00'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBDH	'RMB'	'RMB'
JGQSBJ	0	0
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	0	0
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-12-31	2012-12-31

字段名	'GZ06' 违约处置-委托确认	
	出资方单元	融资方单元
JGQSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGJSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGFSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 空
JGBYBZ		

同时，结算系统将自动对业务留存的质押物进行转托管（证券代号 000002，股份性质 '05'，解押股数 50000 股，质押期间产生的分红派息 5000 元），红利释放至券商自营备付金账户

字段名	'GZ06' 违约处置-转托管明细	
	转入方单元	转出方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZ06'	'GZ06'
JGZQDM	'000002'	'000002'
JGJYXW	'728888'	'006666'
JGTGDY	'728888'	'006666'
JGZQZH	'0066666666'	'0066666666'
JGDDBH	'00888820121231A9000009'	'00888820121231A9000009'
JGZXBH	'090000005'	'090000005'
JGYWLSH		
JGCJSL	0	0
JGQSSL	0	0
JGJSSL	50000	-50000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB		
JGZQZL		

字段名	'GZ06' 违约处置-转托管明细	
	转入方单元	转出方单元
JGGFXZ	'05'	'05'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBBDH	'RMB'	'RMB'
JGQSBJ	0	0
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	0	0
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGJSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGFSRQ	2012-12-31	2012-12-31
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120912A9000088
JGBYBZ		

【实例 6】撤销违约处置：2013-01-02 日，在 2012-12-31 日违约处置之后，融资方拥有了偿还能力，可以申请撤销违约处理；

字段名	'GZ07' 撤销违约处置-委托确认	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户

字段名	'GZ07' 撤销违约处置-委托确认	
	出资方单元	融资方单元
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZ07'	'GZ07'
JGZQDM	'000001'	'000001'
JGJYXW	'009999'	'006666'
JGTGDY	'009999'	'006666'
JGZQZH	'0899999999'	'0066666666'
JGDDBH	'00888820121231A9000012'	'00888820121231A9000012'
JGZXBH	'090000007'	'090000007'
JGYWLSH		
JGCJSL	0	0
JGQSSL	0	0
JGJSSL	0	0
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	'00'	'00'
JGZQZL		
JGGFXZ	'00'	'00'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	'N'	'N'
JGHBBDH	'RMB'	'RMB'
JGQSBJ	0	0
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	0	0
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGQSRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGJSRQ	2013-01-02	2013-01-02

字段名	‘GZ07’ 撤销违约处置-委托确认	
	出资方单元	融资方单元
JGFSRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	‘02’	‘02’
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24位:00888820120822A9000001 25-48位:空	01-24位:00888820120822A9000001 25-48位:空
JGBYBZ		

同时，结算系统将自动对尚未处置的质押物进行转托管（证券代号 000002，股份性质 ‘05’，尚未处置卖出股数 50000 股）

字段名	‘GZ07’ 撤销违约处置-转托管明细	
	转出方单元	转入方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	‘01’	‘01’
JGYWLB	‘GZ07’	‘GZ07’
JGZQDM	‘000001’	‘000001’
JGJYXW	‘728888’	‘006666’
JGTGDY	‘728888’	‘006666’
JGZQZH	‘0066666666’	‘0066666666’
JGDDBH	‘00888820121231A9000012’	‘00888820121231A9000012’
JGZXBH	‘090000007’	‘090000007’
JGYWLSH		
JGCJSL	0	0
JGQSSL	0	0
JGJSSL	-50000	50000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB		
JGZQZL		
JGGFXZ	‘05’	‘05’
JGLTLX	‘0’	‘0’
JGJSFS	‘N’	‘N’
JGHBDH	‘RMB’	‘RMB’

字段名	'GZ07' 撤销违约处置-转托管明细	
	转出方单元	转入方单元
JGQSBJ	0	0
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY		
JGZJJE		
JGSFJE	0	0
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGQSRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGJSRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGFSRQ	2013-01-02	2013-01-02
JGQTRQ		
JGSCDM		
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24位:00888820120822A9000001 25-48位:00888820120912A9000088	01-24位:00888820120822A9000001 25-48位:00888820120912A9000088
JGBYBZ		

【实例 7】部分购回：若未申报前述的解除质押、购回交易、违约处置、撤销违约处置，2012-09-28 日，申报部分购回原初始交易的股份（购回金额 250000 元）：

字段名	'GZ05' 部分购回	
	出资方单元	融资方单元
JGJSZH	结算账户	结算账户
JGBFZH	备付金账户	备付金账户
JGSJLX	'01'	'01'
JGYWLB	'GZ05'	'GZBF'
JGZQDM	'000001'	'000001'

字段名	'GZ05' 部分购回	
	出资方单元	融资方单元
JGJYXW	'009999'	'006666'
JGTGDY	'009999'	'006666'
JGZQZH	'0899999999'	'0066666666'
JGDDBH	'00888820120928A9000010'	'00888820120928A9000010'
JGZXBH	'090000006'	'090000006'
JGYWLSH		
JGCJSL	-100000	100000
JGQSSL	0	100000
JGJSSL	0	100000
JGCJJG		
JGQSJG		
JGXYJY		
JGPCBS		
JGZQLB	'00'	'00'
JGZQZL		
JGGFXZ	'00'	'00'
JGLTLX	'0'	'0'
JGJSFS	N	N
JGHBDH	RMB	RMB
JGQSBJ	250000	-250000
JGYHS		
JGJYJSF		
JGJGGF		
JGGHF		
JGJSF		
JGSXF		
JGQSYJ		
JGQTFY	0	0
JGZJJE		
JGSFJE	250000	250000
JGJSBZ	'Y'	'Y'
JGZYDH		
JGCJRQ	2012-09-28	2012-09-28
JGQSRQ	2012-09-28	2012-09-28
JGJSRQ	2012-09-28	2012-09-28
JGFSRQ	2012-09-28	2012-09-28
JGQTRQ		
JGSCDM		

字段名	'GZ05' 部分购回	
	出资方单元	融资方单元
JGJYFS	'02'	'02'
JGZQDM2		
JGTGDY2		
JGDDBH2		
JGFJSM	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120822A9000001 51-74 位: 00888820120822A9000001	01-24 位:00888820120822A9000001 25-48 位: 00888820120822A9000001 51-74 位: 00888820120822A9000001
JGBYZ		

标的证券参与深交所股票质押回购业务时，初始交易、补充质押及质押期间送转股、配股等引起的股份冻结变更，及解除质押、购回交易、违约处置等引起的股份解冻变更，通过业务类别为‘DJBG’的数据记录下发。业务类别为‘DJ00’的数据记录中包含了质押冻结的数量。

4、综合数据服务库 SJSFW.DBF

取消数据类别‘XD’表示限售股份的冻结股数，限售股份的冻结变更及明细可通过 SJSJG.DBF 中业务类别为‘DJBG’、‘DJ00’的数据记录分别获取。修改数据类别‘11’的定义，由原来的“股份冻结执行机关名称”改为“股份司法冻结/质押冻结明细”，数据范围包括流通股和限售股的司法冻结和质押冻结，内容增加了冻结股数、冻结类型等，详见下表。SJSFW.DBF 具体结构请见《中国结算深圳分公司系统优化二期参与人技术系统变更指南 V1.0》。

FWSJLB 数据类别	数据类别 含义说明	FWBFZH 备付金账户	FWTGDY 托管单元	FWZQDM 证券代码	FWZQZH 证券账户	FWGFXZ 股份性质	FWLTLX 流通类型	FWMRJE 买入金额	FWMCJE 卖出金额	FWZJYE 资金余额	FWZYSM 摘要说明	FWBZSM 备注说明
11	股份司法 冻结/质 押冻结明 细		托管单元	证券代码	证券账户	股份性质	流通类型	冻结本金	冻结红利	冻结股数	<p>1-2 位表示冻结类型，定义见附录</p> <p>5-20 位填写业务流水号（对于股票质押式回购和债券协议回购为空）</p> <p>23-46 位表示冻结序号（对于股票质押式回购填写初始交易合同序号或补充质押合同序号；对于债券协议回购，23-38 位填写初始合约号）</p> <p>49 位表示是否为可售冻结（' N'：不可售冻结；' Y'：可售冻结）；</p> <p>52-75 位：若本笔冻结存在司法再冻结，则填写司法再冻结序号，其余为空；</p> <p>77-84 位：冻结截止日期,格式为 CCYYMMDD，若为 00010101 表示无限期冻结。</p>	<p>质权人或执 行机关名 称，左对齐 （对于股票 质押式回购 和债券质押 式协议回购 为空）</p>

5、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 的“技术专区/深圳市场/数据接口规范”栏目。

(2) 关于清算明细库 SJSXM0.DBF、交收结果库 SJSJG.DBF 和资金变动库 SJSZJ.DBF，之前版本均基于《中国结算深圳分公司结算参与人数据接口规范（Ver1.32）》，目前我司已完成结算系统优化一期的改造，股票质押回购业务亦属于优化改造范围，这三个接口关于股票质押式回购业务的描述还可参见《中国结算深圳分公司结算系统优化参与人技术变更指南》：

<http://www.chinaclear.cn/zdjs/jstz/201410/29f7e41cc3b54d8292c9ea446fe23888.shtml>；

利息划转请参见《中国结算深圳分公司结算参与人资金实时交收数据接口规范》：

<http://www.chinaclear.cn/zdjs/jstz/201408/42e8db34b44b47da8410b5ba676f228b.shtml>

。

(3) 联系方式

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

电话: 0755-25946080

附件三、股票质押回购业务数据报送指南

1、业务要求说明

为满足交易所对股票质押回购业务监管的需要，确保股票质押回购业务顺利开展，券商应于当日清算完毕后至下一个交易日（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 日股票质押回购相关业务数据文件。内容包括：股票质押回购融入方报告、股票质押回购融出方报告、股票质押回购盯市报告等数据文件。各类数据文件说明如下：

(1) 股票质押回购融入方报告：填报券商最近一次股票质押回购融入方名单报送以来的变动情况，包括新增、撤销或资料更新。

(2) 股票质押回购融出方报告：填报券商当前股票质押回购融出方的完整名单，含已经出资和未实际出资的所有融出方；

(3) 股票质押回购盯市报告：填报券商 T 日当日了结的股票质押回购合约以及所有截止 T 日仍未了结的股票质押回购合约情况；

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
股票质押回购融入方报告	ZYHG0000_20120810.dbf
股票质押回购融出方报告	ZYHG0001_20120810.dbf
股票质押回购盯市报告	ZYHG0002_20120810.dbf

券商通过深交所会员业务专区的“公文及报表上传”报送股票质押回购业务数据文件，要求一次性报送所有的股票质押回购业务数据文件（3 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、股票质押回购融入方报告 ZYHG0000_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	'ZYHG'=股票质押回购
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	对于机构客户有效
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	是否合格融入方	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

股票质押回购融入方报告: 券商最近一次股票质押回购融入方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 'ZYHG', 表示股票质押回购融入方报告。

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

(3) ZZDM (组织机构代码): 对于机构客户有效, 个人客户设置为全空格。9 位长度, 不含中间的 '-'。

(4) YWLB (业务指令类别): 'N' 表示首次报送该客户的资料或对之前报送的客户 (同一客户证券账户号) 的资料进行修改; 'C' (撤销): 撤销客户 (同一客户证券账户号) 在券商处进行股票质押回购交易权限; 对于已被券商撤销交易权限的客户, 后续不允许券商对其资料进行修改。

(5) QSRQ (风险揭示书签署日期): 客户与券商签订风险揭示书的日期。

(6) KTRQ (交易权限开通日期): 允许客户在券商处进行股票质押回购相关

交易业务的开始日期。

(7) CXRQ(交易权限撤销日期): 撤销客户在券商处进行股票质押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客户, 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(是否合格融入方): 固定设置为‘1’, 表示合格融入方。

(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、股票质押回购融出方报告 ZYHG0001_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	‘ZYHG’=股票质押回购
2	CZFZH	融出方证券账户号	C	10	
3	CZFMC	融出方名称	C	128	
4	CZFLB	融出方类别	C	2	‘01’=证券公司自营 ‘02’=证券公司集合或专项计划 ‘03’=资管子公司集合或专项计划 ‘04’=证券公司定向客户 ‘05’=资管子公司定向客户
5	BSFS	数据报送方式	C	1	‘A’=增量 ‘R’=全量
6	SLRQ	设立日期	C	8	格式:CCYYMMDD
7	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格

股票质押回购融出方报告: 填报券商当前股票质押回购融出方的完整名单, 含已经出资和未实际出资的所有融出方。

(1) YWMC(业务名称): 固定填写为‘ZYHG’, 表示股票质押回购的融出方报告。

(2) BSFS(数据报送方式): 固定为‘R’, 表示采用全量数据报送方式。

(3) SLRQ(设立日期): 融出方类别为 02、04 时, 填写计划设立日期, 融出方类别为 03、05 时, 填写定向资产管理合同签订日期。

5、股票质押回购盯市报告 ZYHG0002_ccyymmdd.dbf

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注	备注 2
1	CSJYRQ	初始交易日期	C	8	格式:CCYYMMDD	*
2	CSHTXH	初始合同序号	C	22		*

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注	备注 2
3	ZQDM	证券代码	C	6		
4	CSJYJE	初始交易金额	N	18,2	单位:元	*
5	CSGHQX	初始购回期限	N	4,0	单位:天	*
6	CSGHRQ	初始购回日期	C	8	格式:CCYYMMDD	*
7	CSGHJE	初始购回金额	N	18,2	单位:元	*
8	CSRZLL	初始融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%	*
9	ZQRLX	质权人类型	C	2	‘01’=证券公司为融出方, 证券公司为登记的质权人 ‘02’=证券公司集合或专项资产管理计划产品为融出方, 证券公司为登记的质权人 ‘03’=证券公司资产管理子公司集合或专项资产管理计划产品为融出方, 证券公司资产管理子公司为登记的质权人 ‘04’=证券公司定向资产管理客户为融出方, 定向客户为登记的质权人 ‘05’=证券公司定向资产管理客户为融出方, 证券公司为登记的质权人 ‘06’=证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方, 定向客户为登记的质权人 ‘07’=证券公司资产管理子公司定向资产管理客户为融出方, 证券公司资产管理子公司为登记的质权人	*
10	RZFYFJE	融入方应付金额	N	18,2	单位:元	*
11	SJRZLL	实际融资利率	N	9,4	年化收益率 单位:%	*
12	CSJYSL	初始交易数量	N	10,0	单位:股	
13	BCZYSL	累计补充质押数量	N	10,0	单位:股	
14	JCZYSL	累计解除质押数量	N	10,0	单位:股	
15	HGSL	质押红股数量	N	10,0	单位:股	
16	DQZYSL	当前质押数量	N	10,0	单位:股	
17	HLJE	质押红利金额	N	18,2	单位:元	
18	LYBZBL	履约保障比例	N	9,2	单位:%	*
19	LYBZJB	履约保障级别	C	1	‘0’=正常 ‘1’=警戒 ‘2’=触发	*
20	HYZT	合约状态	C	1	‘0’=未到期 ‘1’=已到期未了结	*

序号	字段名	字段描述	类型	长度	备注	备注 2
					'2'=当日已了结 '9'=违约处置中	
21	LJLX	了结类型	C	2	'00'=未了结 '01'=提前购回 '02'=到期购回 '03'=延期购回 '04'=终止购回 '09'=违约处置了结	*
22	ZJYTMS	资金用途描述	C	100	简要描述客户资金用途	*
23	YWBYZD	业务备用字段	C	100	预留字段, 全空格	
24	ZJYTLX	资金用途类型	C	2	01=生产经营 02=补充流动资金 03=股权类投资 04=债权类投资 05=不动产投资 06=偿还债务 07=个人消费 99=其他	*
25	YJX	预警线	N	9,2	单位: %	*
26	PCX	平仓线	N	9,2	单位: %	*
27	QTDBWMS	其他担保物描述	C	100	20 个汉字左右	*
28	QTDBWJZ	其他担保物价值	N	18,2	单位: 元	*

股票质押回购盯市报告: 填报券商 T 日当日内了结的股票质押回购合约以及所有截止 T 日仍未了结 (包括 T 日申报的初始交易) 的股票质押回购合约情况。T 日了结的合约自 T+1 日起不再报送。

(1) ZQDM(证券代码): 质押标的证券代码, 对于后续补充质押了与初始交易不同标的证券或返还了配股权证的, 每个标的证券/配股权证单列一行; 对于后续补充质押标的证券与初始交易相同的, 合并填写为一行。

(2) CSGHQX(初始购回期限): 初始交易时约定的购回期限, 即初始交易日起至初始购回日期之间的自然日数。

(3) CSGHRQ(初始购回日期): 初始交易时约定的购回日期。

(4) CSGHJE(初始购回金额): 初始交易时约定的购回金额。

(5) CSRZLL(初始融资利率): 初始交易时约定的融资利率, 计量单位为年化收益率%, 如预期融资利率为 5.0000%, 则初始融资利率字段填报数值应为 5.0000 (下同)。

(6) ZQRLX(质权人类型): 初始交易时约定的质权人类型。

(7) RZFYFJE(融入方应付金额): 根据利息计提与支付、部分购回等情况调整; 对于当日了结的合约, 填报该笔合约实际的购回金额。

(8) SJRZLL(实际融资利率): 对于未了结的合约, 填写该笔合约初始交易时约定的预期融资利率, 即与 CSRZLL 相同; 对于当日了结的合约, 填报该笔合约实际的融资利率。计量单位为年化收益率%。

(9) CSJYSL(初始交易数量): 标的证券的初始交易数量, 对于后续补充质押的不同标的证券, 其初始交易数量填 0。

(10) BCZYSL(累计补充质押数量): 标的证券从初始交易之日起, 至 T 日期间的所有补充质押交易的数量之和, 不含权益分派后自动质押的红股。

(11) JCZYSL(累计解除质押数量): 标的证券从初始交易之日起, 至 T 日(含)期间的所有部分解除质押交易的数量之和。

(12) HGSL(质押红股数量): 标的证券从初始交易之日起, 至 T 日(含)期间的所有权益分派所获得的红股数量之和。

(13) DQZYSL(当前质押数量): 标的证券当前的质押在押数量, 含权益分派后自动质押的红股, $DQZYSL=CSJYSL+BCZYSL-JCZYSL+HGSL$; 对于当日了结的合约, 填报该笔合约实际的购回数量。

(14) HLJE(质押红利金额): 标的证券从初始交易之日起, 至 T 日(含)期间的所有权益分派所获得的红利金额之和。

(15) LYBZBL(履约保障比例): 所有一篮子质押标的证券市值与质押红利金额之和与融入方应付金额的比值, 单位: %; 例如, 合约当前的履约保障比例为 185%, 则履约保障比例字段填报时应为 185.00。

(16) 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预警线; 警戒表示履约保障比例达到或低于预警线, 未达到平仓线; 触发表示履约保障比例达到或低于平仓线。

(17) HYZT(合约状态): 申报了违约处置指令后合约状态应填写: 9“违约处置中”; 在这之后又申报了违约处置撤销指令的, 其合约状态需变更为: 0“未到期”。

(18) ZJYTMS (资金用途描述): 简要描述客户从本股票质押回购初始交易中
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。

(19) 接口说明中备注 2 字段标*号的, 与整个一篮子合约相关, 同一初始交
易合同序号填报数值相同; 未标注*号的, 与标的证券相关, 同一初始交易合同序
号下不同的标的证券填报数值可以不同。