

编号: SZSE999999-TG15

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

资产管理计划份额转让业务之

券商技术系统变更指南

(Ver1.21)



深圳证券交易所
中国证券登记结算有限公司
二〇一七年二月

关于本文档

文档名称	资产管理计划份额转让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
2013-4-25	0.99	创建文档	征求意见稿
2013-5-17	1.00	修订文档	根据相关券商的反馈意见修订
2014-7-1	1.10	修订文档	新增中国结算总公司结算代码00和自建TA结算代码09
2016-7-31	1.20	修订文档	升级到新一代交易系统接口
2017-2-21	1.21	修订文档	(本文档中橙色修订部分) 新增本方交易账户和对手方交易账户

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.....	3
3.2	STEP 接口委托申报.....	5
3.3	交易终端委托申报.....	9
3.4	委托申报样例.....	10
四、	成交回报.....	15
4.1	Binary 接口成交回报.....	15
4.2	STEP 接口成交回报.....	17
五、	清算交收与税费标准.....	19
六、	开展资管产品转让业务时券商系统注意事项.....	23
6.1	行情相关说明.....	23
6.2	委托相关说明.....	23
6.3	关于券商柜台系统.....	23
七、	联系方式.....	24
附件一、	资产管理计划份额转让业务的交易数据接口修订说明.....	25

资产管理计划份额转让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资产管理计划份额（以下简称“资管份额”）转让业务，本所会同中国证券登记结算有限公司（以下简称“中国结算”）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

转出方指持有资管份额，希望获得资金并转出资管份额的客户，本文档将该类客户的交易行为又称转出。

转入方指持有资金，希望获得资管份额并支付资金的客户，本文档将该类客户的交易行为又称转入。

2.1 交易流程

(1) 投资者向证券公司发出资管份额的转入、转出意向委托；

(2) 证券公司按照业务方案确定的交易规则，将转入方、转出方的委托匹配成交；

(3) 证券公司按照规定格式提交委托申报；

(4) 本所交易系统对委托申报进行确认，向证券公司即时发送成交回报数据，并将确认结果发送给结算机构；

(5) 份额登记和资金划付等业务处理服务，根据结算机构代码，由不同的结算机构依据本所的确认结果分别进行。其中，结算机构代码为 00 的，由中国结算总公司进行；结算机构代码为 01 的，由中国结算深圳分公司进行；结算机构代码

为 09 的，由自建 TA 所属证券公司进行。

2.2 证券代码

资产管理计划的证券代码区间为【113001， 113999】、【119501， 119999】，经本所审核同意后方可生效。

2.3 交易单元

委托申报只能通过该证券公司的指定交易单元申报。

2.4 合格投资者

结算机构代码为 00 和 01 的，转入方、转出方必须为同一家证券公司或同一销售代理人的客户。

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。

2.5 其他说明

(1) 资产管理计划份额转让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) 委托申报数量应当大于等于业务方案规定的最低门槛且为申报基数的整数倍。

(3) 委托申报价格应当符合业务方案及相关规定。

(4) T 日转入的资管份额，T 日可以转出。

(5) 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，并实施份额、资金前端监控。

三、 委托申报

资管产品份额转让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、或者交易终端的方式申报委托。委托申报当日有效，一经申报不得撤销。

资产管理计划份额转让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

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=100803	
ApplID	应用标识	080: 资产管理计划份额 转让
SubmittingPBUID	申报交易单元	资管计划指定交易单元
SecurityID	证券代码	资管计划证券代码
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	00: 中国结算总公司 01: 中国结算深圳分公司 09: 自建 TA
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	转让价格
LastQty	数量	转让数量
TrdType	成交申报业务类别	0
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留, 固定填 0	固定填 0
ConfirmID	约定号	全空格
Side	本方与人买卖方向	1: 买入
PBUID	本方交易单元	转入方交易单元, 或转入 方销售代理人码 (3 位数 字, 可以左补 0 或右补空

		格)
AccountID	本方证券账户	转入方证券账户,或转入方场外基金账户(后十位,右补空格),或转入方自建TA账户(后十位,右补空格)
BranchID	本方营业部代码	转入方客户所在营业部识别码;如果转入方客户使用的是场外基金账户或自建TA账户,则为‘00’
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	转出方交易单元,或转出方销售代理人码(3位数字,可以左补0或右补空格)
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	转出方证券账户,或转出方场外基金账户(后十位,右补空格),或转出方自建TA账户(后十位,右补空格)
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	转出方客户所在营业部识别码;如果转出方客户使用的是场外基金账户或自建TA账户,则为‘00’
PriceType	价格类型 1=Percentage,表示收益率 3=Fixed amount,表示绝对价格	3:按“人民币现金”报价
ExecutingTrader	本方交易账户	转入方客户交易账户
CounterpartyExecutingTrader	对手方交易账户	转出方客户交易账户

说明:

(1) SubmittingPBUID (申报交易单元) 应当填写为证券公司指定的交易单元。

(2) 如果转入方/转出方均使用深市证券账户,则 ClearingFirm (结算机构代码) 字段取值应当填写为“01”,指中国结算深圳分公司负责清算、交收。如果转出方/转入方均使用场外基金账户(后十位,右补空格),则字段取值应当填写为“00”,指中国结算总公司负责清算、交收。如果转出方/转入方均为自建TA账户

(后十位, 右补空格), 则字段取值应当填为“09”, 指自建 TA 所属证券公司负责清算、交收。转出方/转入方使用的应是同一类型的账户, 以确保结算机构清算、交收正确。

(3) 如果转入方使用深市证券账户, PBUID (本方交易单元) 应当填写为转入方交易单元。如果转入方使用场外基金账户或者自建 TA 账户, PBUID 应当填写为转入方销售代理人码 (3 位数字), 可以左补 0 或右补空格。例如, 转入方销售代理人码为 677, 则 PBUID 可以填写为“000677”或者“677 ”。

(4) 如果转出方使用深市证券账户, CounterpartyPBUID (对手方交易单元) 应当填写为转出方交易单元。如果转出方使用场外基金账户或者自建 TA 账户, CounterpartyPBUID 应当填写为转出方销售代理人码 (3 位数字), 可以左补 0 或右补空格。例如, 转出方销售代理人码为 677, 则 CounterpartyPBUID 可以填写为“000677”或者“677 ”。

(5) 如果 ClearingFirm (结算机构代码) 为“01” (中国结算深圳分公司), 则转入方交易单元 (PBUID)、转出方交易单元 (CounterpartyPBUID) 与申报交易单元 (SubmittingPBUID) 应当属于同一家会员。

(6) PriceType (价格类型) 指 LastPx (价格) 的业务含义。其值为“3”表示人民币现金, 比如 LastPx (价格) 的字段值为 1.5010, 表示每份资管份额的转让价格为 1.5010 元人民币现金; 其值为“1”表示与结算标的证券换算比例, 目前业务尚未启用, 为技术系统预留值。

(7) ExecutingTrader (转入方交易账户)、CounterpartyExecutingTrader (转出方交易账户) 的填写说明。交易账户是指投资者在销售机构开设的用于投资者在该销售机构处申报申购赎回等基金业务的账号。如果 ClearingFirm (结算机构代码) 为“00” (中国结算总公司) 或“01” (中国结算深圳分公司), 则必须填写对应的转入方、转出方交易账户, 且不能为全空格; 如果 ClearingFirm (结算机构代码) 为“09” (自建 TA), 则填写为全空格。

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	080
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
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
组件<Instrument>			
48	SecurityID	证券代码	资管计划证券代码
22	SecurityIDSource	证券代码源 102=深圳证券交易所	102
组件结束			
组件<RootParties>			
1116	NoRootPartyIDs	参与人代码个数	2
→	1117	RootPartyID	参与人代码
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色
	1117	RootPartyID	参与人代码 00: 中国结算总公司 01: 中国结算深圳分公司 09: 自建 TA
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色
组件结束			
组件<TrdCapRptSideGrp>			

552	NoSides		side 个数	2	
→	54	Side	买卖方向	1: 转入方	
	组件<Parties>				
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	4	
	→	448	PartyID	参与人代码	转入方交易单元, 或转入方销售代理人码(3位数字, 可以左补0或不补0)
		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	转入方证券账户, 或转入方场外基金账户(后十位), 或转入方自建TA账户(后十位)
		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	转入方客户所在营业部识别码; 如果转入方客户使用的是场外基金账户或自建TA账户, 则为'00'
		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
		448	PartyID	参与人代码	转入方交易账户; 如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
		447	PartyIDSource	参与人代码源	D: 自定义代码 如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
		452	PartyRole	参与人代码角色	12: 交易员 如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
		组件结束			
		54	Side	买卖方向	2: 转出方
	组件<Parties>				
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	4	
	→	448	PartyID	参与人代码	转出方交易单元, 或转

				出方销售代理人码(3位数字,可以左补0或不补0)
	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	转出方证券账户,或转出方场外基金账户(后十位),或转出方自建TA账户(后十位)
	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	转出方客户所在营业部识别码;如果转出方客户使用的是场外基金账户或自建TA账户,则为'00'
	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
	448	PartyID	参与人代码	转出方交易账户;如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
	447	PartyIDSource	参与人代码源	D: 自定义代码 如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
	452	PartyRole	参与人代码角色	12: 交易员 如果结算机构为09(自建TA)则不需要填写
组件结束				
组件结束				
31	LastPx		成交价格	转让价格
32	LastQty		成交数量	转让数量
423	PriceType		价格类型 1=Percentage, 表示收益率 3=Fixed amount, 表示绝对价格	3: 按“人民币现金”报价

说明: 字段取值参见 Binary 接口说明部分。

3.3 交易终端委托申报

客户订单号:	<input type="text"/>	转入方营业部代码:	<input type="text" value="输入营业部代码"/>
交易单元:	<input type="text"/>	转入方交易单元:	<input type="text"/>
转入方证券账户:	<input type="text"/>	证券代码:	<input type="text"/>
价格:	<input type="text"/>	数量:	<input type="text"/>
所有者类型:	<input type="text" value="个人投资者发起"/>	转出方证券账户:	<input type="text"/>
转出方交易单元:	<input type="text"/>	转出方营业部代码:	<input type="text" value="输入营业部代码"/>
结算机构代码:	<input type="text" value="00"/>	转入方交易账户:	<input type="text"/>
转出方交易账户:	<input type="text"/>		

说明:

(1) 交易单元字段值应当填写为证券公司指定的交易单元。

(2) 如果转入方/转出方均使用深市证券账户，则结算机构代码字段值应当填写为 01，指中国结算深圳分公司负责清算、交收。如果转出方/转入方均使用场外基金账户（后十位，右补空格），则字段取值应当填写为 00，指中国结算总公司负责清算、交收。如果转出方/转入方均为自建 TA 账户（后十位，右补空格），则字段取值应当填写为 09，指自建 TA 所属证券公司负责清算、交收。转出方/转入方使用的应是同一类型的账户，以确保结算机构清算、交收正确。

(3) 如果转入方使用场外基金账户或者自建 TA 账户，转入方交易单元字段值应当填写为转入方销售代理人码（3 位数字），左补 0；转入方营业部代码字段值应当填写为 00。例如，转入方销售代理人码为 677，则转入方交易单元应当填写为 000677。

(4) 如果转出方使用场外基金账户或者自建 TA 账户，转出方交易单元字段值应当填写为转出方销售代理人码（3 位数字），左补 0；转出方营业部代码字段值应当填写为 00。例如，转出方销售代理人码为 677，则转出方交易单元应当填写为 000677。

(5) 如果结算机构代码字段值为 01（中国结算深圳分公司），则转入方交易单元、转出方交易单元、与交易单元应当属于同一家会员。

3.4 委托申报样例

3.4.1 委托申报样例一

本所为证券公司资产管理计划分配的证券代码为 119668，证券公司指定的申报交易单元为 008888，结算机构为中国结算深圳分公司。20120620 日该证券公司的转入方客户（交易单元 007777、证券账户 0866666666、营业部识别码 A9、交易账户 11000000000000222），与该证券公司的转出方客户（交易单元 006789、证券账户 0055555555、营业部识别码 AB、交易账户 11000000000000333）达成转让，转让数量为 1000 份，转让价格为每份 1.204 元人民币。则证券公司技术系统需按下列格式申报指令：

表 3-1 委托申报 BINARY 消息示例

域名	取值
MsgType	100803
AppID	080
SubmittingPBUID	008888
SecurityID	119668
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	01
TransactTime	20120620-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	1
TradeReportRefID	全空格
LastPx	1.2040
LastQty	1000.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	全空格
Side	1
PBUID	007777
AccountID	0866666666
BranchID	A9
CounterpartyPBUID	006789
CounterpartyAccountID	0055555555

CounterpartyBranchID	AB
PriceType	3
ExecutingTrader	11000000000000222
CounterpartyExecutingTrader	11000000000000333

STEP 消息如下:

1180=080<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1
123=1<SOH>60=20120620-14:42:13:555<SOH>48=119668<SOH>22=102<SOH>111
6=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=4<SOH>448=007777<SOH>44
7=C<SOH>452=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=A9
<SOH>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=11000000000000222<SOH>447=D<SOH
>452=12<SOH>54=2<SOH>453=4<SOH>448=006789<SOH>447=C<SOH>452=1<S
OH>448=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=AB<SOH>447=D<SO
H>452=4001<SOH>448=11000000000000333<SOH>447=D<SOH>452=12<SOH>31
=1.2040<SOH>32=1000.00<SOH>423=3<SOH>

交易终端委托申报如下:

客户订单号: <input type="text" value="A0000001"/>	转入方营业部代码: <input type="text" value="A9"/>
交易单元: <input type="text" value="008888"/>	转入方交易单元: <input type="text" value="007777"/>
转入方证券账户: <input type="text" value="0866666666"/>	证券代码: <input type="text" value="119668"/>
价格: <input type="text" value="1.204"/>	数量: <input type="text" value="1000"/>
所有者类型: <input type="text" value="会员发起"/>	转出方证券账户: <input type="text" value="0055555555"/>
转出方交易单元: <input type="text" value="006789"/>	转出方营业部代码: <input type="text" value="AB"/>
结算机构代码: <input type="text" value="01"/>	转入方交易账户: <input type="text" value="11000000000000222"/>
转出方交易账户: <input type="text" value="11000000000000333"/>	

提交

重置

3.4.1 委托申报样例二

本所为证券公司资产管理计划分配的证券代码为 119668, 证券公司指定的申报交易单元为 008888, 结算机构为中国结算总公司。20120620 日该证券公司的转入方客户 (销售代理人码 677、场外基金账户后十位 0866666666、交易账户 11000000000000222), 与该证券公司的转出方客户 (销售代理人码 677、场外基金

账户后十位 0055555555、交易账户 11000000000000333) 达成转让, 转让数量为 1000 份, 转让价格为每份 1.204 元人民币。则证券公司技术系统需按下列格式申报指令:

表 3-2 委托申报 BINARY 消息示例

域名	取值
MsgType	100803
ApplID	080
SubmittingPBUID	008888
SecurityID	119668
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	00
TransactTime	20120620-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	1
TradeReportRefID	全空格
LastPx	1.2040
LastQty	1000.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	全空格
Side	1
PBUID	000677 或者 677
AccountID	0866666666
BranchID	00
CounterpartyPBUID	000677 或者 677
CounterpartyAccountID	0055555555
CounterpartyBranchID	00
PriceType	3
ExecutingTrader	11000000000000222
CounterpartyExecutingTrader	11000000000000333

STEP 消息如下:

1180=080<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1
123=1<SOH>60=20120620-14:42:13:555<SOH>48=119668<SOH>22=102<SOH>111

6=2<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=00<SOH>1118=F
<SOH>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=1<SOH>453=4<SOH>448=677<SOH>447=C
<SOH>452=1<SOH>448=0866666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=00<SO
H>447=D<SOH>452=4001<SOH>448=11000000000000222<SOH>447=D<SOH>45
2=12<SOH>54=2<SOH>453=4<SOH>448=677<SOH>447=C<SOH>452=1<SOH>44
8=0055555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=00<SOH>447=D<SOH>452=4
001<SOH>448=11000000000000333<SOH>447=D<SOH>452=12<SOH>31=1.2040<
SOH>32=1000.00<SOH>423=3<SOH>

交易终端委托申报如下：

客户订单号：	<input type="text" value="A0000001"/>	转入方营业部代码：	<input type="text" value="00"/>
交易单元：	<input type="text" value="008888"/>	转入方交易单元：	<input type="text" value="000677"/>
转入方证券账户：	<input type="text" value="0866666666"/>	证券代码：	<input type="text" value="119668"/>
价格：	<input type="text" value="1.204"/>	数量：	<input type="text" value="1000"/>
所有者类型：	<input type="text" value="会员发起"/>	转出方证券账户：	<input type="text" value="0055555555"/>
转出方交易单元：	<input type="text" value="000677"/>	转出方营业部代码：	<input type="text" value="00"/>
结算机构代码：	<input type="text" value="00"/>	转入方交易账户：	<input type="text" value="11000000000000222"/>
转出方交易账户：	<input type="text" value="11000000000000333"/>		

3.4.1 委托申报样例三

本所为证券公司资产管理计划分配的证券代码为 119668，证券公司指定的申报交易单元为 008888，结算机构为自建 TA 所属证券公司。20120620 日该证券公司的转入方客户（销售代理人码 677、自建 TA 账户后十位为 0A66666666），与该证券公司的转出方客户（销售代理人码 588、自建 TA 账户后十位为 0B55555555）达成转让，转让数量为 1000 份，转让价格为每份 1.204 元人民币。则证券公司技术系统需按下列格式申报指令：

表 3-3 委托申报 BINARY 消息示例

域名	取值
MsgType	100803
ApplID	080
SubmittingPBUID	008888

SecurityID	119668
SecurityIDSource	102
OwnerType	102
ClearingFirm	09
TransactTime	20120620-14:42:13:555
UserInfo	全空格
TradeReportID	A0000001
TradeReportType	0
TradeReportTransType	0
TradeHandlingInstr	1
TradeReportRefID	全空格
LastPx	1.2040
LastQty	1000.00
TrdType	0
TrdSubType	0
ConfirmID	全空格
Side	1
PBUID	000677 或者 677
AccountID	0A66666666
BranchID	00
CounterpartyPBUID	000588 或者 588
CounterpartyAccountID	0B55555555
CounterpartyBranchID	00
PriceType	3
ExecutingTrader	全空格
CounterpartyExecutingTrader	全空格

STEP 消息如下:

1180=080<SOH>571=A0000001<SOH>522=102<SOH>856=0<SOH>487=0<SOH>1
123=1<SOH>60=20120620-14:42:13:555<SOH>48=119668<SOH>22=102<SOH>111
6=2<SOH>1117=008888<SOH>1118=C<SOH>1119=1<SOH>1117=09<SOH>1118=F
<SOH>1119=4<SOH>552=2<SOH>54=1<SOH>453=3<SOH>448=677<SOH>447=C
<SOH>452=1<SOH>448=0A66666666<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=00<S
OH>447=D<SOH>452=4001<SOH>54=2<SOH>453=3<SOH>448=588<SOH>447=C
<SOH>452=1<SOH>448=0B55555555<SOH>447=5<SOH>452=5<SOH>448=00<S
OH>447=D<SOH>452=4001<SOH>31=1.2040<SOH>32=1000.00<SOH>423=3<SO
H>

交易终端委托申报如下：

客户订单号： <input type="text" value="A0000001"/>	转入方营业部代码： <input type="text" value="00"/>
交易单元： <input type="text" value="008888"/>	转入方交易单元： <input type="text" value="000677"/>
转入方证券账户： <input type="text" value="0A66666666"/>	证券代码： <input type="text" value="119668"/>
价格： <input type="text" value="1.204"/>	数量： <input type="text" value="1000"/>
所有者类型： <input type="text" value="会员发起"/>	转出方证券账户： <input type="text" value="0B55555555"/>
转出方交易单元： <input type="text" value="000588"/>	转出方营业部代码： <input type="text" value="00"/>
结算机构代码： <input type="text" value="09"/>	转入方交易账户： <input type="text"/>
转出方交易账户： <input type="text"/>	

四、 成交回报

对于资管产品份额转让业务的委托申报，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 接口成交回报

域名	字段描述	字段取值
Standard Header	消息头 MsgType=200804	
ReportIndex	回报记录号	
ApplID	应用标识	080：资产管理计划份额转让
ReportingPBUID	回报交易单元	资管计划委托申报交易单元
SubmittingPBUID	申报交易单元	资管计划委托申报交易单元
SecurityID	证券代码	资管计划委托申报对应字段值
SecurityIDSource	证券代码源	资管计划委托申报对应字段值
OwnerType	订单所有者类型	资管计划委托申报对应字段值

ClearingFirm	结算机构代码	资管计划委托申报对应 字段值
TransactTime	回报时间	成交回报时间
UserInfo	用户私有信息	资管计划委托申报对应 字段值
TradeID	交易所成交申报编号	
TradeReportID	客户成交申报编号	资管计划委托申报对应 字段值
TradeReportType	成交申报类型	资管计划委托申报对应 字段值
TradeReportTransType	成交申报事务类别	资管计划委托申报对应 字段值
TradeHandlingInstr	成交申报模式	资管计划委托申报对应 字段值
TradeReportRefID	原客户成交申报编号	资管计划委托申报对应 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	资管计划委托申报对应 字段值
LastQty	数量	资管计划委托申报对应 字段值
TrdType	成交申报业务类别	资管计划委托申报对应 字段值
TrdSubType	成交申报业务子类别 预留	资管计划委托申报对应 字段值
ConfirmID	约定号	资管计划委托申报对应 字段值
ExecID	执行编号	
Side	本方参与人买卖方向	资管计划委托申报对应 字段值
PBUID	本方交易单元	资管计划委托申报对应 字段值
AccountID	本方证券账户	资管计划委托申报对应

		字段值
BranchID	本方营业部代码	资管计划委托申报对应 字段值
CounterpartyPBUID	对手方交易单元	资管计划委托申报对应 字段值
CounterpartyAccountID	对手方证券账户	资管计划委托申报对应 字段值
CounterpartyBranchID	对手方营业部代码	资管计划委托申报对应 字段值
PriceType	价格类型	资管计划委托申报对应 字段值
ExecutingTrader	本方交易账户	资管计划委托申报对应 字段值
CounterpartyExecutingTrader	对手方交易账户	资管计划委托申报对应 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	080
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	资管计划委托申报对 应值
522	OwnerType	成交申报所有者类型	资管计划委托申报对 应值
856	TradeReportType	成交申报类型	资管计划委托申报对 应值

487	TradeReportTransType		成交申报事务类别	资管计划委托申报对 应值
1123	TradeHandlingInstr		成交申报模式	资管计划委托申报对 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
组件<Instrument>				
48	SecurityID		证券代码	资管计划委托申报对 应值
22	SecurityIDSource		证券代码源	资管计划委托申报对 应值
组件结束				
组件<RootParties>				
1116	NoRootPartyIDs		参与人代码个数	资管计划委托申报对 应值
→	1117	RootPartyID	参与人代码	资管计划委托申报对 应值
	1118	RootPartyIDSource	参与人代码源	资管计划委托申报对 应值
	1119	RootPartyRole	参与人代码角色	资管计划委托申报对 应值
组件结束				
组件<TrdCapRptSideGrp>				
552	NoSides		side 个数	资管计划委托申报对 应值
→	54	Side	买卖方向	资管计划委托申报对 应值
	组件<Parties>			
	453	NoPartyIDs	参与人代码个数	资管计划委托申报对 应值

	→	448	PartyID	参与人代码	资管计划委托申报对 应值
		447	PartyIDSource	参与人代码源	资管计划委托申报对 应值
		452	PartyRole	参与人代码角色	资管计划委托申报对 应值
	组件结束				
组件结束					
17	ExecID		执行编号		
31	LastPx		成交价格	资管计划委托申报对 应值	
32	LastQty		成交数量	资管计划委托申报对 应值	
423	PriceType		价格类型	资管计划委托申报对 应值	

五、清算交收与税费标准

5.1 中国结算深圳分公司

中国结算深圳分公司对于资管产品的转让业务，采用 T+1 逐笔全额非担保交收方式。中国结算深圳分公司将通过 D-COM 系统向相关结算参与人于 T 日发送 SJS MX1.DBF 和 T+1 日发送 SJS JG.DBF 两个接口文件，分别表示资管产品转让业务的逐笔清算明细和交收结果，业务类别为‘JY01’。具体接口结构参见《TS(1)-2016-0003 深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 V5.02）》。

SJS MX1.DBF 的数据填写说明如下：

字段名	JY01（综合协议平台 （非担保交收模式））
MXJSZH	结算账号
MXBFZH	备付金账户
MXS JLX	‘01’
MXYWLB	‘JY01’
MXZQDM	证券代码
MXJYDY	交易单元

MXTGDY	托管单元
MXZQZH	证券账户
MXDDBH	订单编号 对于资管份额转让，填写结算参与者申报的合同序号。
MXYYB	营业部代码
MXZXBH	执行编号
MXYWLSH	业务流水号
MXCJSL	成交数量
MXQSSL	清算数量
MXCJJG	交易回报价格
MXQSJG	最终清算价格
MXXYJY	
MXPCBS	
MXZQLB	证券类别
MXZQZL	证券子类别
MXGFXZ	'00'
MXJSFS	交收方式
MXHBDH	货币代号
MXQSBJ	清算本金
MXYHS	印花税
MXJYJSF	交易经手费
MXJGGF	监管规费
MXGHF	过户费
MXJSF	结算费
MXSXF	
MXQSYJ	
MXQTFY	
MXZJJE	
MXSFJE	收付净额
MXCJRQ	T 日

MXQSRQ	T 日
MXJSRQ	T+1 日
MXFSRQ	T 日
MXQTRQ	
MXSCDM	
MXJYFS	'02'
MXZQDM2	
MXTGDY2	
MXDDBH2	
MXCWDH	
MXPPHM	
MXFJSM	
MXBYBZ	

在 T+1 日的 SJSJG.DBF 中，可通过 JGJSBZ 和 JGZYDH 判断交收是否成功，数据填写说明如下：

字段名	JY01 (非担保交易交收)
JGJSZH	结算账号
JGBFZH	备付金账户
JGSJLX	'01'
JGYWLB	' JY01'
JGZQDM	证券代码
JGJYDY	
JGTGDY	托管单元
JGZQZH	证券帐户号码
JGDDBH	订单编号 对于资管份额转让，填写 结算参与者申报的合同序 号。
JGYYP	
JGZXBH	执行编号

JGYWLSH	
JGCJSL	成交数量
JGQSSL	
JGJSSL	实际交收数量或 0
JGCJJG	成交价格
JGQSJG	
JGXYJY	
JGPCBS	
JGZQLB	证券类别
JGZQZL	
JGGFXZ	'00'
JGJSFS	
JGHBDH	
JGQSBJ	
JGYHS	
JGJYJSF	
JGJGGF	
JGGHF	
JGJSF	
JGSXF	
JGQSYJ	
JGQTFY	
JGZJJE	
JGSFJE	
JGJSBZ	'Y' 或 'N'
JGZYDH	若 JGJSBZ 为 'N', 则是 错误代号
JGCJRQ	T-1 日或 T 日
JGQSRQ	
JGJSRQ	
JGFSRQ	T 日
JGQTRQ	

JGSCDM	
JGJYFS	
JGZQDM2	
JGTGDY2	
JGDDBH2	
JGFJSM	
JGBYBZ	

5.2 中国结算总公司

中国结算总公司对于资管份额转让业务,对于同一销售代理人内部不同账户间进行份额转让的,由中国结算总公司负责清算、交收。具体参见中国结算总公司相关文档。

5.3 自建 TA

份额登记托管在证券公司自建 TA 的,由该证券公司根据回报数据自行清算处理。

六、开展资管产品转让业务时券商系统注意事项

6.1 行情相关说明

资管份额转让业务的证券基本资料等信息,不会反映到证券信息文件 securities.xml 中;委托、成交等也不会反映到行情信息中。

6.2 委托相关说明

可以通过交易网关或者交易终端申报委托和接收成交,交易网关可以接收到交易终端申报委托对应的成交,但交易终端不能接收到交易网关申报委托对应的成交。

6.3 关于券商柜台系统

◇ 接收到合格投资者委托时的处理

所有申报的数量、价格等要素必须符合本所相关业务规则以及证券公司事先向本所报备的业务方案。

证券公司应当实施相应的投资者适当性管理,确保向本所交易系统申报的账户均为合法、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。

证券公司应当对转出方和转入方实施份额和资金进行监控。接收到相关委托时，必须正确冻结相应数量的份额和资金；接收到自动撤单回报时，应当记加对应数量的份额和资金。比如，不考虑税费因素，证券公司在接受样例 1的转入方客户委托时应当冻结其资金 1204 元（申报数量 * 申报价格），接受转出方客户委托时应当冻结其 119668 资管份额 1000 份；接收到本所交易系统成交确认记录后，为转入方客户增加 119668 资管份额 1000 份，为转出方客户增加资金 1204 元。

◇ 申报委托

根据事先向本所报备的配对规则将资管份额的转入转出意向委托匹配后，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。而且，交易网关和交易终端申报的客户成交申报编号也不能重复，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，控制其业务规模，避免业务风险。

◇ 交易网关通信线路的网络带宽

当单个交易网关每个交易日的委托申报总笔数达到一定容量（证券公司可自行评估，比如 1 万笔）时，为了不对现货集中竞价交易业务造成冲击，建议证券公司向深圳证券通信公司申请独立的通信线路，并增加交易网关的流速权。该线路应由资管份额转让业务的交易网关专用，不承载现货集中竞价交易业务。

七、 联系方式

业务：0755-88668572（交易）

0755-25945966（结算）

技术：0755-88668679（交易）

Email: ssegcb@szse.cn

0755-25946080（结算）

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

附件一、资产管理计划份额转让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资管产品份额转让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
20005	业务禁止	证券代码不支持资管份额转让业务
20008	价格错误	不是价格档位整数倍
20010	数量非法	不是数量单位整数倍
20011	量额非法	委托数量超过上限
20023	无效单元	转入方交易单元或转出方交易单元不存在
20028	无效单元	委托申报交易单元不是证券公司指定的交易单元
20068	结算机构错	结算机构代码错误
20099	重单	重单
20110	价格类型错	价格类型错误
20111	无效单元	委托申报交易单元、转入方交易单元、转出方交易单元不属于同一会员