

工程技术标准

支持临时停市债券质押式回购业务结 算暂行办法之券商技术系统变更指南 (Ver1.00)



深圳证券交易所
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
二〇一七年十月

关于本文档

文档名称		支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法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
2017-10-26	1.00	创建文档	

目 录

一、	说明.....	1
二、	业务简介.....	1
三、	交易处理.....	2
四、	清算和交收.....	3
五、	注意事项.....	3
5.1	关于客户委托服务渠道	3
5.2	关于券商柜台系统	3
六、	联系方式.....	4
附件一、	支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的交易数据接口安排说明.....	5
1	质押式回购初始成交下发市场参与者	5
附件二、	支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的结算数据接口安排说明.....	7
1	结算数据接口安排总体说明	7
1.1	范围及术语说明	7
1.2	清算交收安排	7
1.3	新增临时停市通知文件	7
2	结算数据接口安排详细说明	8
2.1	清算明细库 SJSMX1.DBF 调整说明	8
2.2	证券交易统计库 SJSTJ.DBF 临时停市调整说明.....	8
2.3	T+0 资金清算汇总库 SJSQS0.DBF 临时停市调整说明	8
2.4	资金清算汇总库 SJSQS.DBF 临时停市调整说明.....	9
2.5	明细结果库 SJSJG.DBF 调整说明	9
2.6	临时停市延迟清算数据通知文件 SZYCTZ.DBF.....	9
2.7	其它信息	13

支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法之券商技术系统变更指南

一、说明

为完善交易所市场临时停市风险的应对机制，中国证券登记结算有限责任公司（下称“中国结算”）就债券质押式回购业务制定并发布了《中国证券登记结算有限责任公司临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法》（下称《暂行办法》）。

为支持《暂行办法》的顺利实施，深圳证券交易所（以下简称“深交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中国结算深圳分公司”）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。

本次改造系统的宗旨：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

本指南所称债券质押式回购业务（以下简称“回购业务”）是指在深交所挂牌、实行标准券制度并采用多边净额结算的回购交易。在发生临时停市时，回购业务将进行如下安排：

1、全天临时停市情形：当日到期的回购业务的到期购回清算顺延至下一交易日处理，相关交收相应顺延。到期购回清算时按实际到期购回交收日（不含）与初始交易交收日（含）之间的自然日天数作为资金实际占用天数计算回购利息。

2、日间临时停市后恢复交易且相关交易至少持续两小时直至正常闭市的情形：正常办理回购业务的清算交收。

3、日间临时停市后恢复交易且相关交易至少持续两小时直至正常闭市以外的其它情形：当日新达成的回购业务延至下一交易日清算，相关交收相应顺延。当日新达成的回购业务以初始交易清算日为回购起始日期、以初始交易清算日加回购期限为回购到期日；当日到期的回购业务的到期购回处理同“全天临时停市情形”。

4、因临时停市回购业务延迟清算交收导致结算参与人在延迟清算交收期间发生欠库的，不将其纳入结算参与者违约情形；发生连续欠库的，豁免相应的违约金。

5、因临时停市回购业务延迟清算交收导致结算参与人在延迟清算交收期间发生透支的，不将其纳入结算参与者违约情形，并豁免相应的违约金。

6、最低结算备付金调整时，临时停市当日仍当作交易日计入当月的交易天数。因临时停市顺延至下月清算的交易，不纳入当月证券买入金额进行统计，划归至下月证券买入金额进行统计。

7、结算保证金调整时，临时停市当日仍当作交易日计入当月的交易天数。

三、交易处理

当发生临时停市且需顺延质押式回购业务清算交收的情形时，深交所日间照常实时发送质押式回购业务当日新达成初始成交和到期成交，交易参与者需依据当日深交所发布的临时停市公告，在收市后对质押式回购当日初始成交和到期成交作如下处理：

1、当日新达成初始成交处理

交易参与者从交易网关接收的所有初始成交（Binary: 200215, STEP: 8, ApplID 为：020）除清算交收顺延外，其到期日期（MaturityDate）也需要更新。深交所当日收市后会通过文件网关批量重新发送这一部分初始成交，其中到期日更新为下一交易日加回购期限，交易参与者应通过新收到的初始成交更新临时停市当日已收到的初始成交的到期日。

对于连续多日临时停市的情形，深交所在连续多日临时停市期间的每个交易日收市后都会下发初始成交数据，其下发的初始成交数据中包含了截止当日所有需顺延的初始成交。举例如下：

交易日	临时停市	质押式回购业务顺延情况	当日收市后下发初始成交数据
T	下午半天	顺延	T 日达成初始成交
T+1	全天	顺延	T 日达成初始成交
T+2	下午半天	顺延	T 日、T+2 日达成初始成

			交
T+3	下午半天	顺延	T 日、T+2 日、T+3 日达成初始成交
T+4	正常	正常	不再下发

- 注：1) T 日至 T+3 日都发生临时停市，导致质押式回购业务需要做顺延处理。
2) T+4 日恢复交易。
3) T+1 日全天停市，没有产生成交。

通过文件网关重新发送的初始成交为 csv 文件形式，文件格式说明详见附件一：支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的交易数据接口安排说明。

2、当日到期成交处理

交易参与者从交易网关接收的所有到期回购成交（Binary: 200215，STEP: 8，ApplID 为：029）按作废处理。深交所在下一交易日收市时会将所有已到期在途合约的到期回购成交一并通过交易网关下发给交易参与者，交易参与者可重新收到在临时停市当日作废的那一部分到期回购成交。

四、清算和交收

详见附件二，支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的清算数据接口安排说明。

五、注意事项

5.1 关于客户委托服务渠道

当发生临时停市顺延质押式回购业务，券商柜台系统应提供多种渠道提醒投资者，并向投资者充分揭示清算交收延迟等风险。

5.2 关于券商柜台系统

临时停市发生的概率极低，券商在进行技术系统改造时要注意控制风险，简化对现有系统的改造。

六、 联系方式

业务：0755-88668511（交易）

0755-25938030（结算）

技术：0755-88668728（交易）

Email: ssegcb@szse.cn

0755-25946080（结算）

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

附件一、支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的交易数据接口安排说明

1 质押式回购初始成交下发市场参与者

文件名为 repo_execution_memberID_YYYYMMDD.csv，其中 memberID 为交易参与人在深交所的会员 ID，YYYYMMDD 为对应的交易日。如发生临时停市并需顺延质押式回购业务清算交收时，深交所在当日收市后下发该文件。

文件内容为因发生临时停市需要顺延的质押式回购初始成交，到期日为“下一交易日+回购期限”。若交易参与者没有需要顺延的初始成交，则会下发一个记录数为 0 的空文件。文件记录各字段与质押式回购成交 binary 消息相同。

表 1-1 质押式回购初始成交 repo_execution_*.csv 内容定义

域名	类型	字段描述
ReportIndex	N18	回报记录号，从 1 开始顺序编号
ApplID	C3	应用标识
ReportingPBUID	C6	回报交易单元
SubmittingPBUID	C6	申报交易单元
SecurityID	C8	证券代码
SecurityIDSource	C4	证券代码源
OwnerType	N4	订单所有者类型
ClearingFirm	C2	结算机构代码
TransactTime	N17	回报时间，格式为：YYYYMMDDHHMMSSsss
UserInfo	C8	用户私有信息
OrderID	C16	交易所订单编号
ClOrdID	C10	客户订单编号
ExecID	C16	执行编号
ExecType	C1	执行类型
OrdStatus	C1	订单状态
LastPx	N13(4)	成交价
LastQty	N15(2)	成交数量
LeavesQty	N15(2)	订单剩余数量
CumQty	N15(2)	累计执行数量
Side	C1	买卖方向
AccountID	C12	证券账户
BranchID	C4	营业部代码
MaturityDate	N8	到期日，格式为：YYYYMMDD

注：

1. TransactTime（回报时间）为初始成交达成交易的时间，不是当日下发的时间，如初始成交的成交时间为：20171019094000000，若 10 月 19 日、10 月 20 日发生临时停市，则 10 月 20 日下发的数据中，回报时间仍为：20171019094000000。
2. 记录的每个字段之间以逗号分隔，每条记录以行分隔符 0x0A 结束，首字段前和尾字段后不附加字段分隔符 TAB，最后一条记录后也附加行分隔符。
3. 对于 Nx(y)定点数类型的字段内容带小数点，小数位补齐，整数位不足部分不左补空格，比如价格字段类型 N13(4)的示例为“15.2300”或“-14.0210”；整数型字段内容仅包含实际整数值，左右都不补空格，比如“1500”；char[x]字符串型字段内容包含字符串实际值去掉右边的空格部分。
4. 市场参与者系统应能支持记录尾部扩展新的字段，不使用新扩展的字段时应能自动忽略新字段而不需做技术改造。

附件二、支持临时停市债券质押式回购业务结算暂行办法的结算数据接口安排说明

1 结算数据接口安排总体说明

1.1 范围及术语说明

本说明对发生临时停市并需顺延债券质押式回购业务清算交收时的数据接口安排进行描述，临时停市的其他相关业务将另行安排，临时停市未涉及调整的数据接口仍按照《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.1）》执行。

术语解释：

T 日：临时停市日；

R 日：临时停市后第一个正常交易日。

临时停市期间：若连续多天临时停市，表示临时停市首日至 R 日的前一工作日。

1.2 清算交收安排

- 1) T 日新达成的初始成交顺延至 R 日清算，对应的交收顺延至 R+1 日。T 日的日终清算文件中不包含相关初始交易清算数据。
- 2) 顺延的初始交易对应的购回交易相应顺延，以 R 日作为回购的起始日，其到期日调整为（R 日+回购期限）。
- 3) T 日到期的购回成交顺延至 R 日清算，对应的交收顺延至 R+1 日。T 日的日终清算文件中不包含相关到期购回清算数据。
- 4) R 日日终的清算数据文件合并了因临时停市延迟清算的相关数据，交收后其资金的变动情况体现在 R+1 日的 SJSZJ.DBF 中。

1.3 新增临时停市通知文件

- 1) T 日日终发送文件 SZYCTZ.DBF，文件内容包括临时停市期间需顺延清算的债券质押式回购初始交易和到期购回的相关通知数据。
- 2) 在连续多天临时停市的情况下，停市期间每日累计发送截止到当日需顺延清算的债券质押式回购初始交易和到期购回数据。
- 3) SZYCTZ.DBF 不是最终的清算数据文件，仅供市场参与者参考。此文件仅在临时停市的情况下发送，平时不发送。

2 结算数据接口安排详细说明

2.1 清算明细库 SJSMX1.DBF 调整说明

业务类别	临时停市期间	临时停市后第一个正常交易日 (R 日)
HGCS (债券质押式回购初始成交)	无此类别的清算数据	1、包括临时停市期间顺延和 R 日新达成的初始交易清算明细数据, 可通过成交日期 (MXCJRQ) 字段进行区分。 2、对于临时停市期间达成并顺延至 R 日清算的初始交易: 成交日期(MXCJRQ)=初始交易达成的实际日期; 清算日期(MXQSRQ)=R 日; 交收日期(MXJSRQ)=清算日期的下一工作日; 到期日期(MXQTRQ)调整为 R 日+回购期限。
HGDQ (债券质押式回购到期成交)	无此类别的清算数据	1、包括临时停市期间到期和 R 日到期的回购交易清算明细数据。 2、对于临时停市期间到期的购回交易: 成交日期(MXCJRQ)=清算日期 (MXQSRQ)=R 日; 交收日期(MXJSRQ)=清算日期的下一工作日。

2.2 证券交易统计库 SJSTJ.DBF 临时停市调整说明

证券代码	临时停市期间	临时停市后第一个正常交易日 (R 日)
TJZQDM=债券质押式回购产品证券代码	无此类别的清算数据	包括临时停市期间和 R 日的债券质押式回购交易, 按“证券代码+托管单元”粒度进行合并汇总。 成交日期(TJCJRQ)=R 日。

2.3 T+0 资金清算汇总库 SJSQS0.DBF 临时停市调整说明

业务类别	临时停市期间	临时停市后第一个正常交易日 (R 日)
HGCS (债券质押式回购初始成交)	无此类别的清算数据	临时停市期间和 R 日的交易合并进行净额扎差。 成交日期(QSCJRQ)=清算日期 (QSQSRQ)=R 日; 交收日期(QSJSRQ)=清算日期的下一工作日。
HGDQ (债券质押式回购到期成交)	无此类别的清算数据	临时停市期间和 R 日的交易合并进行净额扎差。 成交日期(QSCJRQ)=清算日期 (QSQSRQ)=R 日; 交收日期(QSJSRQ)=清算日期的下一工

	作日。
--	-----

2.4 资金清算汇总库 SJSQS.DBF 临时停市调整说明

业务类别	临时停市期间	临时停市后第一个正常交易日（R 日）
HGCS （债券质押式回购初始成交）	无此类别的清算数据	临时停市期间和 R 日的交易合并进行净额扎差。 成交日期(QSCJRQ)=清算日期(QSQRQ)=R 日； 交收日期(QSJSRQ)=清算日期的下一工作日。
HGDQ （债券质押式回购到期成交）	无此类别的清算数据	临时停市期间和 R 日的交易合并进行净额扎差。 成交日期(QSCJRQ)=清算日期(QSQRQ)=R 日； 交收日期(QSJSRQ)=清算日期的下一工作日。

2.5 明细结果库 SJSJG.DBF 调整说明

业务类别	临时停市期间	临时停市后第一个正常交易日（R 日）
ZQHY （债券未到期回购合约）	由于到期回购延迟清算处理，日终发送的合约数据包含原到期日为当天的数据	数据无差异
ZYBZ （质押库标准券净额数据）	由于到期回购延迟清算处理，已回购融出的标准券张数(JGQSSL)包含原到期日为当天的数据	数据无差异

2.6 临时停市延迟清算数据通知文件 SZYCTZ.DBF

SZYCTZ.DBF 的文件格式同 SJSMXn.DBF，具体结构及定义请参见《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.1）》。

临时停市期间债券质押式回购新达成的初始交易和到期购回交易顺延至下一正常交易日清算，这部分业务在临时停市期间每日通过文件 SZYCTZ.DBF 中的‘HGCS’、‘HGDQ’进行通知。SZYCTZ.DBF 具体内容请参见下表：

字段名	业务类别	
	HGCS(质押式回购初始成交)	HGDQ(质押式回购到期成交)
MXJSZH	结算账号	结算账号

字段名	业务类别	
	HGCS(质押式回购初始成交)	HGDQ(质押式回购到期成交)
MXBFZH	备付金账户	备付金账户
MXSJLX	'01'	'01'
MXYWLB	'HGCS'	'HGDQ'
MXZQDM	证券代码	债券代码
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
MXYYPB	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	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
MXCJIG	到期利率	到期利率
MXQSJG	最终清算价格	最终清算价格
MXXYJY		
MXPCBS		
MXZQLB	证券类别	证券类别
MXZQZL	证券子类别	证券子类别
MXGFXZ	股份性质	'00'
MXJSFS	'A'	'A'
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	初始成交日期

字段名	业务类别	
	HGCS(质押式回购初始成交)	HGDQ(质押式回购到期成交)
MXSCDM		
MXJYFS	'02'	'02'
MXZQDM2		
MXTGDY2		
MXDDBH2		
MXCWDH		
MXPPHM		
MXFJSM		
MXBYBZ		

以下是对 SZYCTZ.DBF 接口的示例化说明。

【示例 1】 2017-11-01 日发生日间临时停市且未正常闭市。当天停市前，正回购方（融资方）与逆回购方（融券方）达成 1 天期债券质押式回购交易（证券代号 131810），回购金额 10,000,000 元，每百元资金到期年收益为 3.555 。

正回购方：交易单元为 000001，托管单元为 000001，结算账号为 000001，客户订单编号为 A123456789，证券账户为 0005555551。

逆回购方：交易单元为 000002，托管单元为 000002，结算账号为 000002 客户订单编号为 B123456789，证券账户为 0005555552。

【示例 2】 2017-11-01 日发生日间临时停市且未正常闭市。正回购方（融资方）与逆回购方（融券方）在 2017-10-31 日达成 1 天期债券质押式回购交易（证券代号 131810）正常在 2017-11-01 日到期，其初始交易达成的回购金额 10,000,000 元，每百元资金到期年收益为 3.555。

正回购方：交易单元为 000001，托管单元为 000001，结算账号为 000001，客户订单编号为 A223456789，证券账户为 0005555551。

逆回购方：交易单元为 000002，托管单元为 000002，结算账号为 000002 客户订单编号为 B223456789，证券账户为 0005555552。

字段名	示例 1		示例 2	
	正回购方	逆回购方	正回购方	逆回购方
MXJSZH	000001	000002	000001	000002
MXBFZH	B001000001	B001000002	B001000001	B001000002
MXSJLX	'01'	'01'	'01'	'01'

字段名	示例 1		示例 2	
	正回购方	逆回购方	正回购方	逆回购方
MXYWLB	'HGCS'	'HGCS'	'HGDQ'	'HGDQ'
MXZQDM	131810	131810	131810	131810
MXJYDY	000001	000002	000001	000002
MXTGDY	000001	000002	000001	000002
MXZQZH	0005555551	0005555552	0005555551	0005555552
MXDDBH	A123456789	B123456789	A223456789	B223456789
MXYYB	营业部代码	营业部代码	营业部代码	营业部代码
MXZXBH	执行编号	执行编号	执行编号	执行编号
MXYWLSH	1711011000000001	1711011000000002	1711011000000003	1711011000000004
MXCJSL	-100,000	100,000	100,000	-100,000
MXQSSL	-100,000	100,000	100,000	-100,000
MXCJG	3.555	3.555	3.555	3.555
MXQSJG	100	100	100.009739730	100.009739730
MXXYJY				
MXPCBS				
MXZQLB	13	13	13	13
MXZQZL				
MXGFXZ	00	00	00	00
MXJSFS	'A'	'A'	'A'	'A'
MXHBDH	RMB	RMB	RMB	RMB
MXQSBJ	10,000,000	-10,000,000	-10,000,973.97	10,000,973.97
MXYHS				
MXJYJSF				
MXJGGF				
MXGHF				
MXJSF				
MXSXF				
MXQSYJ				
MXQTFY				
MXZJJE				
MXSFJE	10,000,000	-10,000,000	-10,000,973.97	10,000,973.97
MXCJRQ	20171101	20171101	20171101	20171101
MXQSRQ	20171101	20171101	20171101	20171101
MXJSRQ	20171102	20171102	20171102	20171102
MXFSRQ	20171101	20171101	20171101	20171101
MXQTRQ	20171102	20171102	20171031	20171031
MXSCDM				
MXJYFS	'02'	'02'	'02'	'02'

字段名	示例 1		示例 2	
	正回购方	逆回购方	正回购方	逆回购方
MXZQDM2				
MXTGDY2				
MXDDBH2				
MXCWDH				
MXPPHM				
MXFJSM				
MXBYBZ				

2.7 其它信息

(1) 《深市登记结算数据接口规范（结算参与人版 Ver5.1）》可在中国结算网站 www.chinaclear.cn 首页之“服务支持”-“业务资料”-“接口规范”-“深圳市场”下载。

(2) 技术联系方式

Email: szjsb@chinaclear.com.cn

电话: 0755-25946080